

SFB
823

Statistik nichtlinearer dynamischer Prozesse

Ausgabe 16

Sprecher: Prof. Dr. Walter Krämer
Geschäftsstelle: Melanie Große
Geschäftsführung: Dr. Thorsten Ziebach

Technische Universität Dortmund
Fakultät Statistik
Institut für Wirtschafts- und Sozialstatistik
D-44221 Dortmund

Telefon: 0231 / 755-3125
Fax: 0231 / 755-5284
e-Post: walter.kraemer@tu-dortmund.de

Info-Brief



SFB
823

Liebe Kolleginnen und Kollegen,
Mitarbeiterinnen und Mitarbeiter unseres SFBs,

in der empirischen Wirtschaftsforschung gibt es zwei Spitzenpositionen: Chefberater der Regierung und Chefberater der Nationalbank. In beiden ist nun unser SFB mit jeweils einem Projektleiter vertreten. Darauf bin ich nicht wenig stolz, das zeigt, dass unsere Leistung auch außerhalb der Wissenschaft auf Anerkennung stößt.

Schon seit 2009 gehört unser Projektleiter Christoph Schmidt (A3) dem Sachverständigenrat zur Begutachtung der gesamtwirtschaftlichen Entwicklung ("Rat der fünf Weisen") an, seit 2013 ist er dessen Vorsitzender. Damit ist er in gewisser Weise der einflussreichste Ökonom der Bundesrepublik.



Quelle: SVR

Christoph Schmidt übergibt das Jahresgutachten 2017 an die Bundeskanzlerin

Und seit Oktober 2017 ist unser Projektleiter Martin Wagner (A3/A4) der Chefvolkswirt der Nationalbank von Slowenien. Er wird diesen Posten auf Teilzeitbasis bekleiden und bleibt der TU Dortmund und dem SFB erhalten. Auch diese Berufung zeigt, welche Wertschätzung die an unserer Universität geleistete Arbeit in der Politik genießt. Denn als Chefvolkswirt der Nationalbank hat Martin Wagner genau das empirisch umzusetzen, was er in seinen Projekten theoretisch erforscht: Wie wirken sich staatliche Maßnahmen wie ein Drehen an der Zinsschraube oder eine Ausweitung der Geldmenge auf Wachstum und Preise aus? Durch welche Kanäle strömen eigentlich die Impulse, die eine Nationalbank dem Wirtschaftsgeschehen ihres Landes geben kann?

Aber nicht nur hier ist unser SFB im Zentrum des internationalen Forschungsgeschehens gut sichtbar aktiv. Ich stelle die empirische Wirtschaftsforschung nur deshalb besonders heraus, weil das mein eigenes Arbeitsgebiet ist und ich mich

hier am besten auskenne. Aber auch unsere Biometriker und Technometriker schlafen nicht; wir werden weit über die Grenzen Deutschlands hinaus als ein Zentrum der angewandten Statistik wahrgenommen (siehe den Bericht über den Workshop "New Developments in Econometrics and Time Series" in Rom auf S. 11). Helfen Sie mit, dass dieses Licht noch weitere drei Jahre leuchtet, und geben wir dann die Flamme an den nächsten Großforschungsverbund aus unserer Mitte weiter.

Und bitte in den Terminkalender eintragen; vom 25.-26. Oktober 2018 gibt es die nächste SFB-Klausurtagung in Lüdenscheid.

Ihr hoffnungsvoller SFB-Sprecher Walter Krämer

Rufe, Ehrungen und Preise

Axel Bücher (A7) hat einen Ruf an die Heinrich-Heine-Universität Düsseldorf auf eine W3-Professur für Mathematische Statistik und Wahrscheinlichkeitstheorie erhalten.

Herold Dehling (C1, C3) wurde zum Chair des Publication Committee der Bernoulli Society gewählt.

Christoph Schmidt (A3) wurde zum ordentlichen Mitglied der Nordrhein-westfälischen Akademie der Wissenschaften und der Künste gewählt.

Den Geehrten und Berufenen die herzlichsten Glückwünsche!

Veröffentlichungen

1) Publikationen in Fachzeitschriften

Seit dem letzten Infobrief zur Veröffentlichung angenommen:

M. Hüsch (A1), B. U. Schyska und L. von Bremen (2018). CorClustST - Correlation-based Clustering of Big Spatio-Temporal Datasets, erscheint in: *Future Generation Computer Systems*.

F. Akashi, H. Dette (A1, C1, C2, T1) und Y. Liu: Change Point Detection in Autoregressive Models with no Moment Assumptions, erscheint in: *Journal of Time Series Analysis*.

D. Belomestny (B3, C5), V. Panov und J. Woerner (C5): Low-Frequency Estimation of Continuous-Time Moving Average Lévy Processes, erscheint in: *Bernoulli*.

D. Belomestny (B3, C5), M. Trabs und A. Tsybakov: Sparse Covariance Matrix Estimation in High-Dimensional Deconvolution, erscheint in: *Bernoulli*.

D. Belomestny (B3, C5), W. K. Härdle und E. Krymova (B3): Sieve Estimation of the Minimal Entropy Martingale Marginal Density, erscheint in: *International Journal of Theoretical and Applied Finance*.

A. Bücher (A7) und I. Kojadinovic: A Note on Conditional versus Joint Unconditional Weak Convergence in Bootstrap Consistency Results, erscheint in: *Journal of Theoretical Probability*.

D. Giraud (C3): Invariance Principle via Orthomartingale Approximation, erscheint in: *Stochastics and Dynamics*.

P. Grabarczyk (A3), M. Wagner (A3, A4), Manuel Frondel (A3) und Stephan Sommer (A3): A Cointegrating Polynomial Regression Analysis of the Material Kuznets Curve Hypothesis, erscheint in: *Resources Policy*.

M. Hoffmann (A1), M. Vetter und H. Dette (A1, C1, C2, T1): Nonparametric Inference of Gradual Changes in the Jump Behavior of Time-Continuous Processes, erscheint in: *Stochastic Processes and their Applications*.

Y. Hoga (A4): Detecting Tail Risk Differences in Multivariate Time Series, erscheint in: *Journal of Time Series Analysis*.

Y. Hoga (A4): Confidence Intervals for Conditional Tail Risk Measures in ARMA-GARCH Models, erscheint in: *Journal of Business & Economic Statistics*.

Y. Hoga (A4): A Structural Break Test for Extremal Dependence in β -Mixing Random Vectors, erscheint in: *Biometrika*.

P. Jung (A5) und M. Kuhn: Earnings Losses and Labor Mobility over the Lifecycle, erscheint in: *Journal of the European Economic Association*.

K. Leckey (B5): On Densities for Solutions to Stochastic Fixed Point Equations, erscheint in: *Random Structures and Algorithms*.

K. Leckey (B5), R. Neininger und H. Sulzbach: Process Convergence for the Complexity of Radix Selection on Markov Sources, erscheint in: *Stochastic Processes and their Applications*.

K. Möllenhoff (A1), H. Dette (T1, C1, C2, T1), E. Kotzagiorgis, S. Volgushev und O. Collignon: Regulatory Assessment of Drug Dissolutions Profiles Comparability via Maximum Deviation, erscheint in: *Statistics in Medicine*.

J. Tewes (C1), D. J. Nordman und D. N. Politis: Convolved Subsampling Estimation with Application to Block Bootstrap, erscheint in: *Annals of Statistics*.

Seit dem letzten Infobrief erschienen:

P. Bagchi, V. Characiejus (C1) und H. Dette (A1, C1, T1): A Simple Test for White Noise in Functional Time Series, *Journal of Time Series Analysis* 39, 54-74 (2018).

D. Biermann und M. Kansteiner (beide B4): Carbonbeton – Herausforderung für Diamantwerkzeuge?, *Der Betonbohrer – Fachzeitschrift für Diamanttechnik* 41, 52-55 (2017).

S. Birr (C1), S. Volgushev, T. Kley, H. Dette (A1, C1, C2, T1) und M. Hallin: Quantile Spectral Analysis for Locally Stationary Time Series, *Journal of the Royal Statistical Society, Ser. B* 79(5), 1619-1643 (2017).

- F. Bretz, K. Möllenhoff (A1), H. Dette (T1, C1, C2, T1), W. Liu und M. Trampisch: Assessing the Similarity of Dose Response and Target Doses in Two Non-overlapping Subgroups, *Statistics in Medicine* 37 (5), 722-738 (2018).
- J. Buchsteiner (C1): The Function-indexed Sequential Empirical Process under Long-range Dependence, *Bernoulli* 24, 2154-2175 (2018).
- A. Bücher (A7) und J. Segers: Inference for Heavy Tailed Stationary Time Series based on Sliding Blocks, *Electronic Journal of Statistics* 12 (1), 1098-1125 (2018).
- B. R. Clarke, A. Höller, Ch. H. Müller (B4, B5), K. Wamahiu: Investigation of the Performance of Trimmed Estimators of Life Time Distributions with Censoring Data, *Australian & New Zealand Journal of Statistics* 59, 513-525 (2017).
- A. van Delft (A1, A7) und M. Eichler: Locally Stationary Functional Time Series, *Electronic Journal of Statistics* 12 (1), 107-170 (2018).
- H. Dehling (C1, C3), D. Vogel, M. Wendler (C1) und D. Wied: Testing for Changes in Kendall's tau, *Econometric Theory* 33, 1352-1386 (2017).
- H. Dette (C1, C2), R. Guchenko, V. B. Melas und W. K. Wong: Optimal Discrimination Designs for Semi-parametric Models, *Biometrika* 105 (1), 185-197 (2018).
- H. Dette (C1, C2), K. Kettelhake, K. Schorning (C1, C2), W. K. Wong und F. Bretz (T1): Optimal Designs for Active Controlled Dose Finding Trials with Efficacy-Toxicity Outcomes, *Biometrika* 104 (4), 1003-1010 (2017).
- B. P. M. Duarte, W. K. Wong und H. Dette (C1, C2, T1): Adaptive Grid Semidefinite Programming for Finding Optimal Designs, *Statistics and Computing* 28, 441-460 (2018).
- K. Eckle (C4), N. Bissantz (C4) und H. Dette (A1, C1): Multiscale Inference for Multivariate Deconvolution, *Electronic Journal of Statistics* 11 (2), 4179-4219 (2017).
- K. Eckle (C4), N. Bissantz (C4), H. Dette (A1, C1), K. Proksch und S. Einecke: Multiscale Inference for a Multivariate Density with Applications to X-ray Astronomy, *Annals of the Institute of Statistical Mathematics* 70 (3), 647-689 (2018).
- C. Feller, K. Schorning (C2), H. Dette (A1, C1, C2), G. Bermann und B. Bornkamp: Optimal Designs for Dose Response Curves with Common Parameters, *Annals of Statistics* 45 (5), 2102-2132 (2017).
- C. Gerstenberger (C3): Robust Wilcoxon-type Estimation of Change-Point Location under Short-Range Dependence, *Journal of Time Series Analysis* 39, 90-104 (2018).
- R. van Hecke (C1), S. Volgushev und H. Dette (A1, C1): Fourier Analysis of Serial Dependence Measures, *Journal of Time Series Analysis* 39, 75-89 (2018).
- K. Ickstadt (B5), M. Schäfer und M. Zucknick: Toward Integrative Bayesian Analysis in Molecular Biology, *Annual Review of Statistics and its Application* 5 (2018).
DOI: 10.1146/annurev.statistics-031017-100438
- J. Müller und P. N. Posch (A7): Wrong-way-risk in Tails, *Journal of Asset Management* (2018).
DOI: 10.1057/s41260-018-0076-9

P. N. Posch, D. Ullmann (beide A7) und D. Wied: Detecting Structural Changes in Large Portfolios, *Empirical Economics*, 1-17 (2018).

DOI: 10.1007/s00181-017-1392-5

H. Rafeld, S. Fritz-Morgenthal und P. Posch (A7): Applying Control Balance Theory to the Rogue Traders Nick Leeson, Jérôme Kerviel, and Kweku Adoboli, *Journal of Financial Compliance* 1 (3), 276-284 (2017).

H. Rafeld, S. Fritz-Morgenthal und P. Posch (A7): Behavioural Patterns in Rogue Trading: Analysing the Cases of Nick Leeson, Jérôme Kerviel and Kweku Adoboli, *Journal of Financial Compliance* 1 (2), 156-171 (2017).

S. Siebert, K. Ickstadt (B5), Y. Radon und P. Verveer: Comparison of Clustering Approaches with Application to Dual Colour Protein Data, *IET Systems Biology* 12 (1), 7-17 (2018).

DOI: 10.1049/iet.syb.2017.0019

J. Tewes (C1): Block Bootstrap for the Empirical Process of Long-range Dependent Data, *Journal of Time Series Analysis* 39, 28-53 (2018).

M. Wagner (A3, A4) und D. Wied: Consistent Monitoring of Cointegrating Relationships: The US Housing Market and the Subprime Crisis, *Journal of Time Series Analysis* 38(6), 960-980 (2017).

2) Veröffentlichungen in Sammelbänden, Buchbeiträge, Bücher (nur bereits erschienene)

J. Gauer, A. Nagathil und R. Martin (alle B3): Binaural Spectral Complexity Reduction of Music Signals for Cochlear Implant Listeners, Proceedings IEEE International Conference on Acoustics, Speech, and Signal Processing (ICASSP), Calgary, Canada, April 2018.

W. Krämer (A1, Z) und K. Morik (Hrsg.): Daten – Wem gehören sie, wer speichert sie, wer darf darauf zugreifen?, Verlag F. Schöningh, Paderborn (2018).

W. Tillmann (B1, B4), D. Biermann (B4), C. Müller (B4, B5), S. Alkas Yonan, M. Ferreira (B4), L. Wojarski, M. Kansteiner (B4) und M. Becke: Influence Of The Distance Between Single Diamonds On The Scratching Behavior On Concrete, EURO PM 2018, International Powder Metallurgy Congress & Exhibition, 14.10.-18.10.2018, Bilbao, Spain (auch Vortrag).

3) Populärwissenschaftliche Texte

W. Krämer (A1): Interview mit dem Präsidenten des Statistischen Bundesamtes Dr. Georg Thiel, *AStA Wirtschafts- und Sozialwissenschaftliches Archiv* 12 (1), 1-6 (2018).

W. Krämer (A1): Interview mit Nanny Wermuth, *AStA Wirtschafts- und Sozialwissenschaftliches Archiv* 11 (3-4), 245-251 (2017).

4) Medienbeiträge

W. Krämer (A1): Interview "Vorsicht bei epidemiologischen Studien", *Deutsche Welle*, 10.12.2017.

Vorträge

1) Eingeladene Haupt- und Plenarvorträge

R. Fried (C3): robts - an R-package for Robust Time Series and Change-Point Analysis, CRoNoS Spring Course on Multivariate Data Analysis and Software, Limassol, 03.-05.04.2018.

W. Krämer (A1, Z): Lüge-Notlüge-Statistik: Was ist dran an diesem Vorurteil, TU Dortmund, Zwischen Brötchen und Borussia, 14.10.2017.

W. Krämer (A1, Z): Die Ökonomie von Panik, Angst und Risiko, 17. Kube-Forum, Kempten, 27.11.2017.

W. Krämer (A1, Z): Fehler und Fallen beim Umgang mit Statistik, Volkssternwarte Recklinghausen, 02.05.2018 (auch: Themenforum, Sparkasse Rheine, 19.04.2018; Unternehmerforum, Hückeswagen, 06.03.2018)

W. Krämer (A1, Z): Was spiegelt der Mietspiegel? Anmerkungen aus der Sicht der Statistik, Deutsche Arbeitsgemeinschaft Statistik (DAGSTAT), Berlin, 14.03.2018.

2) Sonstige Vorträge auf Konferenzen

P. Bagchi (C1): Test for Stationarity in Functional Time Series, IISA International Conference on Statistics, Hyderabad, 27.-30.12.2017.

A. Betken (C3): Robust Change-point Estimation in the Presence of Long-range Dependence, 10th International Conference of the ERCIM WG on Computational and Methodological Statistics (CMStatistics 2017), London, 16.-18.12.2017.

A. Betken (C3): Change-point Tests for LMSV Time Series, 13th German Probability and Statistics Days (Stochastik-Tage), Freiburg, 27.02.-02.03.2018.

A. Bücher (A7): On a Pseudo-Maximum Likelihood Estimator for the Extremal Index, 13th German Probability and Statistics Days (Stochastik-Tage), Freiburg, 27.02.-02.03.2018 (auch: Rotterdam Seminars Econometric Institute, Erasmus University Rotterdam, 22.03.2018).

A. Bücher (A7): On a Sliding Blocks Estimator for the Extremal Index, Workshop über Extremwerte in Meteorologie und Hydrologie, Universität Siegen, 15.03.2018.

H. Dehling (C1, C3): Robust Tests for Change-points in Time Series, Frontier Probability Days 2018, Oregon State University, Corvallis, 29.-31.03.2018.

A. van Delft (A1, A7): Testing for Stationarity of Functional Time Series in the Frequency Domain, Workshop on "New Developments in Econometrics and Time Series", Rom, 16.-17.11.2017.

A. van Delft (A1, A7): A Nonparametric Test for Stationarity in Functional Time Series, 10th International Conference of the ERCIM WG on Computational and Methodological Statistics (CMStatistics 2017), London, 16.-18.12.2017.

H. Dette (A1, C1, C2, T1): Functional Data Analysis for Continuous Functions, Workshop on "Big Data Challenges: Heterogeneity, Model Misspecification and Changepoints", Isaac Newton Institute, Cambridge, 16.04.-20.04.2018.

R. Fried (C3): On Robust Change-Point Detection in Time Series, 10th International Conference of the ERCIM Working Group on Computational and Methodological Statistics (CMStatistics 2017), London, 16.-18.12.2017.

C. Gerstenberger (C3): Robust Change-point Estimation under Short-Range Dependence, 10th International Conference of the ERCIM WG on Computational and Methodological Statistics (CMStatistics 2017), London, 16.-18.12.2017.

D. Giraud (C3): A Deviation Inequality for Martingales and some Applications, 13th German Probability and Statistics Days (Stochastik-Tage), Freiburg, 27.02.-02.03.2018.

K. Ickstadt (B5): Prediction for Stochastic Growth Processes in Fatigue Experiments, 3rd GAMM Activity Group on Uncertainty Quantification (AGUQ) Workshop on Uncertainty Quantification 2018, TU Dortmund, 13.03.2018.

M. Jakubzik (B5): Applications of a Minimum Distance Estimator for Specific Self-Exciting Point Processes, 13th German Probability and Statistics Days (Stochastik-Tage), Freiburg, 27.02.-02.03.2018.

P. Jung (A5): Federal Unemployment Insurance: Theory and an Application to Europe (with K. Kuester and M. Ignaszak), Conference on Macroeconomics and the Labour Market, Bundesbank Frankfurt, 11.05.-12.05.2018.

K. Kokot (T1): Functional Data Analysis in the Banach Space of Continuous Functions, 13th German Probability and Statistics Days (Stochastik-Tage), Freiburg, 27.02.-02.03.2018.

K. Leckey (B5): A Limit Theorem for the Rho-Length of Random Functional Graphs with Fixed Degree Sequences, 13th German Probability and Statistics Days (Stochastik-Tage), Freiburg, 27.02.-02.03.2018.

R. Martin (B3): Speech Enhancement for Hearing Aids, Global Initiative of Academic Networks (GIAN) Course, IIT Guwahati, 23.-27.01.2018.

R. Maurer (B5): Innovative und gut gestaltete Entwürfe für Betonbrücken, Festkolloquium aus Anlass des 80. Geburtstages von Herrn Univ.-Prof. Dr.-Ing. Jürgen Stritzke, Institut für Massivbau der TU Dresden, 13.12.2017.

R. Maurer (B5): Besonderheiten bei der Bemessung von Betonbauteilen im Anwendungsbereich des Wasserhaushaltsgesetzes, Informationszentrum Beton GmbH, Betonbauwerke nach WHG, Paderborn, 05.12.2017.

R. Shevchenko (C5): Drift Estimation for Fractional Ornstein Uhlenbeck Processes with Periodic Structure, 13th German Probability and Statistics Days (Stochastik-Tage), Freiburg, 27.02.-02.03.2018.

M. Wagner (A3, A4): The Asymptotic Validity of Standard FM-OLS in Cointegrating Polynomial Regressions, 11th International Conference on Computational and Financial Econometrics, London, 16.-18.12.2017.

M. Wagner (A3, A4): Some Further Developments in Cointegrating Regression Analysis: Theory for Applications, Einaudi Institute for Economics and Finance, Rom, 23.03.2018 (auch: The Federal Reserve Board, Washington DC, 19.04.2018).

J.H.C. Woerner (C5): Modelling and Inference for Electricity Prices by Oscillating Ornstein-Uhlenbeck Processes, 13th German Probability and Statistics Days (Stochastik-Tage), Freiburg, 27.02.-02.03.2018.

W. Wu (A1): Exchangeable and Non-exchangeable Networks, International Conference on Data Science, Fudan University, Shanghai, 18.12.2017.

3) Vorträge in Fakultätsseminaren

S. Abbas (C3): Control Charts for the Detection of Abrupt Changes in Time Series with Time-varying Trend, LMU München, 06.12.2017.

J. Chown (C4): Regularization Parameter Selection in Indirect Regression by Residual Based Bootstrap, Fachbereich Mathematik, Universität Hamburg, 21.11.2017.

H. Dette (A1, C1, C2, T1): Statistik, Geometrie und Pharmakokinetik, Mathematisches Kolloquium, RWTH Aachen, 28.04.2018.

A. Dürre (C3): Robust Change Point Tests using Bounded Transformations, Universität Siegen, 17.04.2018.

J. Gösmann (A1, C1): Relevant Change Points in High Dimensional Time Series, Forschungsseminar des Instituts für Ökonometrie und Statistik, Universität zu Köln, 12.12.2017.

Ch. Hanck (A4): Robust Inference under Time-Varying Volatility: A Real-Time Evaluation of Professional Forecasters?, Leibniz-Uni Hannover, Institut für Statistik, 22.11.2017 (auch: Karl-Franzens-Uni Graz, Institut für Volkswirtschaftslehre, 21.03.2018).

M. Hoffmann (A1): On Detecting Changes in the Jumps of Arbitrary Size of a Time-Continuous Stochastic Process, FDM-Seminar, Albert-Ludwigs-Universität Freiburg, 24.11.2017.

W. Krämer (A1, Z): On Rating the Raters - Wer ist besser: Moody's oder S+P?, Fakultät für Wirtschaftswissenschaften, Universität Nürnberg, 29.11.2017.

W. Krämer (A1, Z): Fehler und Fallen beim Umgang mit Sozial- und Wirtschaftsdaten, Forschungskolloquium, Hochschule für Angewandte Wissenschaften, Hamburg, 09.05.2018.

S. Kuhnt (B1): Optimization of Computer Experiments with Multiple Responses, Seminarreihe "Data Science", École des Mines de Saint-Étienne, 20.03.2018.

R. Martin (B3): Speech and Music Enhancement for Hearing-impaired Listeners, Forum IKS, Institut für Kommunikationssysteme, RWTH Aachen, 14.12.2017.

M. Wagner (A3, A4): The Asymptotic Validity of Standard FM-OLS in Cointegrating Polynomial Regressions, Essex Business School, Leicester, 08.02.2018.

M. Wagner (A3, A4): The EKC for CO₂ Emissions: A Seemingly Unrelated Cointegrating Polynomial Regressions Approach, The New School, New York, 23.04.2018.

4) Poster

Ch. Hanck (A4): Robust Inference under Time-Varying Volatility: A Real-Time Evaluation of Professional Forecasters?, EC² - European Conferences of the Econometrics Community, Amsterdam, 15.12.2017.

S. Kuhnt (B1), Modellierung und Kontrolle thermokinetischer Beschichtungsprozesse, Kostbare Netzwerke, FH Dortmund, 24.01.2018 (auch: Forschungsfrühstück, Rathaus Dortmund, 09.05.2018).

Promotionen

A. Betken (C3): Change-Point Analysis for Long-Range Dependent Time Series, Fakultät für Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 23.02.2018.

M. Emdadi Fard (B5): Comparison of Prediction Intervals for Crack Growth Based on Random Effects Models, Fakultät Statistik, TU Dortmund, 30.01.2018.

I. Garcia (C3): Change Point Detection in Mean of Short Memory Processes, Fakultät für Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 22.12.2017.

R. Van Hecke (A7): Novel Methods for Spectral Analysis: *U*-Spectral Densities and Integrated Copula Spectra, Fakultät für Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 11.01.2018.

J. Tewes (C1): Change-point Tests and the Bootstrap under Long- and Short-Range Dependence, Fakultät für Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 06.11.2017.

Sonstiges

A. Bücher (A7) vertritt im Sommersemester 2018 eine Professur für Mathematische Statistik an der Heinrich-Heine-Universität Düsseldorf.

S. Tchanyou Ganme (B5) erhielt für Ihre Masterarbeit "Geographical Structures in Birth Data" den Preis für den besten Studienabschluss internationale Studierende des Alumnivereins der Fakultät Statistik.

W. Krämer (A1, Z) wurde zum Mitglied der TU Dortmund Untersuchungskommission zur guten wissenschaftlichen Praxis berufen.

W. Krämer (A1, Z) ist Mitglied der Findungskommission für den Präsidenten der Nordrhein-westfälischen Akademie der Wissenschaften und der Künste.

R. Martin (B3) hat am 20. und 21.01.2018 eine Vortragsreihe zu den Themen *Hearing Loss and Hearing Instruments* sowie *Signal Processing for Hearing Aids* im Rahmen der Winter School on Signal Processing for Speech and Hearing Disorders am Center for Linguistic Science and Technology, IIT Guwahati, gehalten.

Prof. Thomas Mikosch, University of Copenhagen, hat einen Forschungspreis der Alexander von Humboldt-Stiftung erhalten und ist von März bis Mai 2018 und von Oktober 2018 bis Juni 2019 an der Ruhr-Universität Bochum zwecks Kooperation mit H. Dette (A1, C1, C2, T1).

Ch. H. Müller (B4, B5) hat das DAGStat-Symposium "Mietspiegel und Mietpreisbremse: Darf Statistik Politik machen?" am 14.03.2018 organisiert.

Ch. H. Müller (B4, B5) ist Vorsitzende des Programmkomitees der DAGStat-Tagung 2019 in München.

Ch. H. Müller (B4, B5) ist im Programmkomitee der International Conference on Robust Statistics (ICORS 2018) in Leuven.

J. Riehl (B5) erhielt für seine Masterarbeit "Shrinkage-Verfahren für Subgruppenanalysen in klinischen Studien" den Preis für herausragende Abschlussarbeiten des Alumnivereins der Fakultät Statistik.

SFB-Mitglieder unterwegs

A. Betken (C3), H. Dehling (C1, C3), C. Gerstenberger, D. Giraudo (beide C3), S. Schmidt (C1) und K. Vuk (C3) waren vom 12.02. bis 16.02.2018 zu einer gemeinsamen Klausurtagung mit Prof. Martin Wendler an der Universität Greifswald.

S. Kuhnt (B1) war vom 19.03. bis 23.03.2018 zu Gast bei Prof. Olivier Roustant, École des Mines de Saint-Étienne, Frankreich.

Gäste bei uns

Jan Beran (Fachbereich Mathematik und Statistik, Universität Konstanz): Vortrag: "On Nonparametric Time Series Decomposition, with Applications to Climate Data", 06.11.-08.11.2017.

Fabrice Gamboa (Institut de Mathématiques de Toulouse, Université Paul Sabatier): Vortrag: "Approximate Optimal Designs for Multivariate Polynomial Regression", 28.01.-31.01.2018.

Marie Hušková (Faculty of Mathematics and Physics, Charles University Prague): "Structural Breaks in some Panel Data Models", 22.02.-23.02.2018.

Hans Manner (Karl-Franzens-Uni Graz), Vortrag: "Order Invariant Tests for Proper Calibration of Multivariate Density Forecasts", 18.4.2018.

Shahin Tavakoli (Department of Statistics, University of Warwick): Vortrag: "Spatial Modeling Approach to Dialect Sound Variation", 23.04.-25.04.2018.

Dominik Wied (Universität zu Köln): Vortrag: "Testing for Structural Breaks in Factor Copula Models", 15.11.2017.

Anatoly Zhigljavsky (Mathematics Institute, Cardiff University: Forschungsaufenthalt an der Fakultät für Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 19.10.-01.11.2017, 25.03.-28.03.2018.

Chen Zhou (De Nederlandsche Bank, Amsterdam - Erasmus School of Economics, Erasmus University Rotterdam): Vortrag: "Trends in Extreme Value Indices", 22.01.-23.01.2018.

Workshops, Tagungen

Bereits gewesen:

7th Workshop on New Developments in Econometrics and Time Series

16.11.-17.11.2017, EIEF-Einaudi Institute for Economics and Finance, Rom.

Organisation: H. Dette (A1, C1, C2, T1) et al.

<http://www.eief.it/files/2017/09/new-developments-in-econometrics-and-time-series.pdf>



Zum 7. Mal trafen sich, diesmal in Rom, die führenden internationalen Experten aus der Schnittmenge von Ökonometrie und Zeitreihenanalyse in einer von unserem SFB mitorganisierten Konferenzreihe. Links unser stellvertretender SFB-Sprecher Holger Dette, 2. von rechts unser Ex-Projektleiter Marc Hallin

Kommt noch:

16th Workshop on Quality Improvement methods

01.06.-02.06.2018, Esplanade Hotel, Dortmund.

Organisation: Ch.Müller (B4, B5), J. Kunert (C2), S. Kuhnt (B1) et al.

<http://www.statistik.tu-dortmund.de/qim16.html>

Klausurtagung SFB 823,

25.10.-26.10.2018, Mercure Hotel, Lüdenscheid.

Organisation: W. Krämer (A1, Z).

8th Workshop on New Developments in Econometrics and Time Series

20.09.-21.09.2018, Danish Academy of Sciences and Letters, Kopenhagen.

Organisation: H. Dette (A1, C1, C2, T1) et al.

Diskussionspapiere

- 10/18 C. Gerstenberger (C3): Robust Discrimination between Long-Range Dependence and a Change in Mean.
- 9/18 J. Reynolds, L. Sögner, M. Wagner (A3, A4) und D. Wied: Deviations from Triangular Arbitrage Parity in Foreign Exchange and Bitcoin Markets.
- 8/18 J. Kunert (C2) und J. Mielke: Efficient Designs for the Estimation of Mixed and Self Carryover Effects.
- 7/18 J. Chown (C4), C. Heuchenne und I. Van Keilegom: The Nonparametric Location-Scale Mixture Cure Model.
- 6/18 M. Andor, M. Frondel (beide A3) und S. Sommer: Equity and the Willingness to Pay for Green Electricity: Evidence from Germany.
- 5/18 P. Bagchi (C1) und S. Sankar Dhar: A Study on the Least Square Estimator of Multiple Isotonic Regression Function.
- 4/18 M. Hoffmann (A1): On Detecting Changes in the Jumps of Arbitrary Size of a Time-Continuous Stochastic Process.
- 3/18 J. Mielke und J. Kunert (C2): Universally Optimal Crossover Designs for the Estimation of Mixed-Carryover Effects with an Application to Biosimilar Development.
- 2/18 H. Dette und J. Gösmann (beide A1, C1): A Likelihood Ratio Approach to Sequential Change Point Detection.
- 1/18 H. Dette und W. Wu (beide A1, C1): Change Point Analysis in non-stationary Processes - A Mass Excess Approach.
- 24/17 M. Simora, M. Frondel und C. Vance (beide A3): Does Financial Compensation Increase the Acceptance of Power Lines? Evidence from Germany.

- 23/17 S. Kranz, G. Löffler und P. N. Posch (A7): Predatory Short Sales and Bailouts.
- 22/17 K. Schorning und M. Konstantinou (beide C2): Bayesian Optimal Designs for Dose-response Curves with Common Parameters.
- 21/17 M. Frondel (A3) und S. Sommer: Der Wert von Versorgungssicherheit mit Strom: Evidenz für deutsche Haushalte.
- 20/17 H. Dette, M. Konstantinou, K. Schorning und J. Gösmann (alle A1, C2): Optimal Designs for Regression with Spherical Data.

Alle Diskussionspapiere zum Herunterladen unter:
<http://www.statistik.tu-dortmund.de/sfb823-dp.html>