

SFB
823

Statistik nichtlinearer dynamischer Prozesse

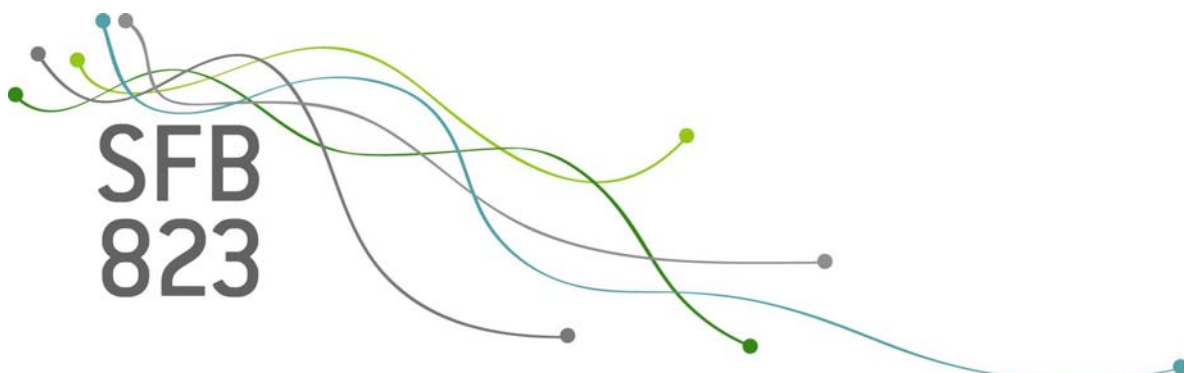
Ausgabe 4

Sprecher: Prof. Dr. Walter Krämer
Geschäftsstelle: Melanie Wübbold
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: walterk@statistik.tu-dortmund.de

Info-Brief



Liebe Freunde, Mitarbeiterinnen und Mitarbeiter, Projektleiterinnen und Projektleiter des SFB 823,

hier schicke ich Ihnen die nächste, wiederum mehr als beeindruckende Liste von Errungenschaften unseres Sonderforschungsbereichs - wenn wir in diesem Tempo weitermachen, könnten wir mit der Zahl unserer Publikationen in rekordverdächtige Regionen vorstoßen. Und auch das erste Patent des SFB ist angemeldet!

Als neues Mitglied begrüße ich den Kollegen Denis Belomestny von der Humboldt Universität Berlin. Er hat dort an dem SFB 649 "Ökonomisches Risiko" mitgearbeitet und vor kurzem einen Ruf an die Uni Duisburg-Essen auf einen Lehrstuhl für Stochastik angenommen. Wir freuen uns sehr, dass die DFG es ihm und uns erlaubt, sein in Berlin begonnenes Projekt im Rahmen unseres eigenen Sonderforschungsbereiches fortzuführen. Bei unserer diesjährigen Klausurtagung in Villigst werden Sie Gelegenheit haben, ihn auch persönlich kennen zu lernen.

Den Termin für dieses Treffen haben Sie doch sicher in Ihrem Kalender rot markiert? Ich gehe davon aus, dort alle Projektleiter und SFB-Beschäftigten zu sehen (hoffentlich in guter Gesundheit und voller Schaffensdrang).

Und dann nähert sich auch unser großes nichtakademisches Projekt – unsere SFB Kinderkrippe – seiner Vollendung; alle Verträge sind unterzeichnet, die Bauarbeiten im Gange, noch in diesem Semester werden die ersten kleinen Nachwuchswissenschaftler unsere Pflegestätte beziehen. Besonders unser Geschäftsführer Dr. Ziebach hat viel Zeit und Energie in dieses Projekt gesteckt, dafür ganz herzlichen Dank.

Walter Krämer
TU Dortmund
Sprecher des SFB 823

Rufe, Ehrungen und Preise

Melanie Birke (C4) hat einen Ruf auf die W2-Professur für Mathematische Statistik an der Universität Bayreuth erhalten und inzwischen angenommen. Wir werden sie vermissen.

Roland Fried (C3) hat einen Ruf auf die Professur "Stochastik und deren Anwendungen" an der Universität Salzburg erhalten. Herzlichen Glückwunsch!

Dominik Wied (A1) und **Daniel Ziggel** haben mit der Arbeit "Handelsstrategien auf Basis von Strukturbrüchen bei Korrelationen und Volatilitäten" den 3. Platz beim VTAD-Award 2011 erzielt. Das ist ein regelmäßiger und hart umkämpfter Wettbewerb des "Vereins der technischen Analysten Deutschlands". Herzlichen Glückwunsch auch an unsere Hobby-Aktienhändler.

Veröffentlichungen

1) Publikationen in Fachzeitschriften

zur Veröffentlichung angenommen:

M. Borowski (C1), M. Görges, R. Fried (C3), O. Such, C. Wrede und M. Imhoff: VDE Position Paper: Medical Device Alarms, erscheint in: *Biomedizinische Technik*.

M. Borowski (C1), S. Siebig, C. Wrede, M. Imhoff: Reducing false alarms of intensive care online-monitoring systems: An evaluation of two signal extraction algorithms, erscheint in: *Computational and Mathematical Methods in Medicine*.

doi:10.1155/2011/143480.

H. Dette (C2), S. Biedermann und D. C. Woods: Optimal design for additive partially nonlinear models, erscheint in: *Biometrika*.

H. Dette (C2), B. Bornkamp, F. Bretz und J. Pinheiro: Response-adaptive dose-finding under model uncertainty, erscheint in: *Annals of Applied Statistics*.

H. Dette, A. Bücher und S. Volgushev (alle A1): New estimators of the Pickands dependence function and a test for extreme-value dependence, erscheint in: *Annals of Statistics*.

H. Dette (C2) und V. B. Melas: A note on the de la Garza phenomenon for locally optimal designs, erscheint in: *Annals of Statistics*.

H. Dette (C2), A. Pepelyshev und W.K. Wong: Optimal experimental design strategies for detecting hormesis, erscheint in: *Risk Analysis: An International Journal*.

H. Dette (A1, C1), P. Preuß und M. Vetter (beide A1): A measure of stationarity in locally stationary processes with applications to testing, erscheint in: *Journal of the American Statistical Association*.

R. Fried (C3): On the online estimation of piecewise constant volatilities, erscheint in: *Computational Statistics and Data Analysis, special issue on computational econometrics*.

R. Fried (C3) und H. Dehling (C3, C5): Robust nonparametric tests for the two-sample location problem, erscheint in: *Statistical Methods and Applications*.

M. Frondel und C. Vance (beide A3): Interpreting the Outcomes of Two-Part Models, erscheint in: *Applied Economic Letters*.

S. Jäschke, K. F. Siburg und P. A. Stoimenov (A1): Modelling dependence of extreme events in energy markets using tail copulas, erscheint in: *Journal of Energy Markets*.

A. Schabert (A4): Exchange Rate Policy under Sovereign Default Risk, erscheint in: *Economics Letters*.

D. Vogel und R. Fried (beide C3): Elliptical graphical modelling, erscheint in: *Biometrika*.

bereits erschienen:

H. Dehling (C3, C5) und O. Durieu: Empirical processes of multidimensional systems with multiple mixing properties, *Stochastic Processes and their Applications* 121, 2011, 1076-1096.

Ch. Hanck und W. Krämer (A1, A4): The exact bias of s^2 in linear panel regressions with spatial autocorrelation, *Economics Letters* 110 (1), 2011, 67-70.

J. Kaiser und W. Krämer (A1, A4): A cautionary note on computing conditional from unconditional correlations, *Economics Letters* 111 (2), 2011, 176-179.

W. Krämer (A1, A4) und M. Bücker (A1): Statistischer Qualitätsvergleich von Kreditausfallprognosen, *AStA Wirtschafts- und Sozialstatistisches Archiv* 5 (1), 39-58.

W. Krämer (A1, A4) und M. van Kampen (A1): A simple nonparametric test for structural change in tail probabilities, *Economics Letters* 110 (3), 2011, 245-247.

S. P. Luque und R. Fried (C3): Recursive filtering for zero offset correction of diving depth time series with GNU R package divemove, *PLoS ONE* 6(1), e15850.

H. Tauchmann (A3), Consistency of Heckman-type two-step Estimators for the Multivariate Sample-Selection Model, *Applied Economics* 42, 2010, 3895-3902.

G. Villa, I. Molina und R. Fried (C3): Modelling Attendance at Spanish Professional Football League, *Journal of Applied Statistics* 38, 2011, 1189-1206.

M. Wendler (C3): Bahadur representation for U-quantiles of dependent data, *Journal of Multivariate Analysis* 102, 2011, 1064-1079.

2) Veröffentlichungen in Sammelbänden (nur bereits erschienene)

U. Gather (C1), S. Kuhnt (B1) and T. Mühlenstädt: Industrial Statistics, in: M. Lovric (Hrsg.), *International Encyclopedia of Statistical Sciences*, 2011, Springer.

3) Sonstige Veröffentlichungen (nur bereits erschienene)

C. Bredemeier und H. Goecke (A4): Sticky Prices vs. Sticky Information – A Cross-Country Study of Inflation Dynamics, *Ruhr Economic Paper* 255.

H. Dehling (C3, C5), E. Glasmachers, J. Härterich und K. Hellermann: MP2-Mathe/Plus/Praxis: Neue Ideen für die Servicelehre, *Mitteilungen der Deutschen Mathematiker Vereinigung* 18, 2010, 252.

4) Patente

Teilprojekt B2: Vorrichtung zum inkrementellen Umformen einer Platine zu einem Bauteil und eine darauf angeordnete Teilpatrizie, die aus einer Mehrzahl von länglichen Flachprofilen, Winkelprofilen, Gewindestangen und Befestigungsstiften errichtbar ist (Industriekooperation mit der Daimler AG, Stuttgart).

Vorträge

1) eingeladene Vorträge auf Konferenzen:

H. Dehling (C3, C5): New Techniques for Empirical Processes of Dependent Data, Conference on Limit Theorems in Probability and Number Theory, Universität Paderborn, 14.-15.01.2011.

R. Fried (C3): Robust Online Monitoring, CIRM workshop: Dependence in probability and statistics, 04.04.-08.04.2011, Marseille-Luminy.

R. Fried (C3): Robust Shift Detection in Time Series, International Conference on Robust Statistics, 19.06.-21.06. 2011, Valladolid.

M. Hallin (C1): Quantiles, spectral analysis and time series, International Nonlinear Time Series Workshop, Institute of Mathematical Sciences, National University of Singapore, 07.02.-18.02.2011.

M. Hallin (C1): Skew-symmetric distributions and Fisher information - A tale of two densities, "Probabilistic and Inferential Aspects of Skew-Symmetric Models: A Workshop in Honour of Adelchi Azzalini's 60th Birthday", Santiago de Chile, 16.05.-19.05.2011.

F. Jüßen (A4): Assortative Mating and Female Labor Supply, Annual Meeting Royal Economic Society, 20.4.2011, London.

W. Krämer (A1, A4): Wahrnehmung von Risiko, Treffpunkt Netze, 22.03.2011, Berlin.

W. Krämer (A1, A4): Ethik der Finanzmärkte, Workshop "Risiko und Verantwortung", Ruhr-Universität Bochum, 02.03.2011.

W. Krämer (A1, A4): Hysterie als Standortnachteil, 4. Freiheitskongress - Zwischen Populismus und Aufklärung, 19.01.2011, Berlin. (außerdem: Jahrestagung Zeitungsverlagsverband NRW, 05.05.2011, Düsseldorf)

D. Wied (A1): Testing for structural changes in the dependence structure of random vectors at an unknown point in time, CIRM workshop: Dependence in probability and statistics, 04.04.-08.04.2011, Marseille-Luminy.

2) Sonstige Vorträge auf Konferenzen:

C. Bredemeier und H. Goecke (A4): Inattentive Voters and Welfare-State Persistence, Scottish Economic Society, Perth, 05.04.2011.

H. Dette (A1, C1, C2): New estimators of the Pickands dependence function and a test for extreme-value dependence, Waseda Symposium, Waseda University, Tokio, 01.03.-02.03.2011.

H. Dette (A1, C1, C2): A measure of stationarity in locally stationary processes with applications to testing, Atami Seminar, Waseda University, Tokio, 03.03.-04.03.2011.

R. Fried (C3): Outliers and Interventions in INGARCH time series, 2nd Workshop on Integer Valued Time Series, 19.06.-21.06.2011 Protaras, Zypern.

M. Frondel (A3): Rarely Enjoyed? A Count Data Analysis of Transit Ridership in Germany's Public Transport, VfS-Jahrestagung 2010, Kiel, 07.09.-10.09.2010.

M. Hallin (C1): Rank based Inference in Linear Models with Stable Errors, Waseda Symposium, Waseda University, Tokio, 01.03.-02.03.2011.

M. Hallin (C1): Skew-symmetric distributions and Fisher information - A tale of two densities, Atami Seminar, Waseda University, Tokio, 03.03.-04.03.2011.

W. Krämer (A1, A4): Zeitvariable Korrelationen auf Finanzmärkten, Jahrestagung des Ökonometrischen Ausschusses des Vereins für Socialpolitik, 25.02.2011, Rauschholzhausen.

N. Ritter (A3): Heterogeneity in the rebound: a quantile regression approach, USAEE/ IAEE Conference "Energy and the Environment: Conventional and Unconventional Solutions", Calgary, Kanada, 14.10.-16.10.2010.

A. Schnurr (C5): Fixed times of discontinuity and jump structures, Workshop: Analysis of Jump Processes, Fakultät für Mathematik, Universität Bielefeld, 15.03.2011.

N. Rudak (B1): Joint optimization of multiple responses based on loss functions, ENBIS Spring Meeting 2011, Turin, 10.03.-18.03.2011.

C. Vance (A3): Determinants of Bicycle Helmet Use: Evidence from Germany, Transportation Research Board, 90th Annual Meeting, TRB, Washington D.C., 23.01.-27.01.2011.

M. van Kampen (A1): A nonparametric constancy test for copulas under mixing conditions, 19th Annual Symposium of the SNDE, 17.03.-18.03.2011, Washington.

M. Wendler (C3): Strong invariance principle for the generalized quantile processes of dependent data, Conference on dependence in probability and statistics, Marseille, 04.-08.03.2011.

3) Vorträge in Fakultätsseminaren:

Herold Dehling (C3, C5): Weakly Dependent Processes in Probability Theory, Statistics and Analysis, Mathematisches Kolloquium, Universität Osnabrück, 02.02.2011.

R. Fried (C3): Robust Online Monitoring, Mathematics Department, Université Libre de Bruxelles, 11.02.2011, Brüssel.

R. Fried (C3): Monitoring von kontaminierten Zeitreihen, Fachbereich Mathematik, Universität Ilmenau, 10.05.2011, Ilmenau.

F. Jüßen (A4): Default Risk Premia on Government Bonds in a Quantitative Macroeconomic Model, House of Finance, Universität Frankfurt, 17.02.2011.

W. Krämer (A1, A4): So lügt man mit Statistik, Max-Planck-Institut zur Erforschung von Gemeinschaftsgütern, Bonn, 09.05.2011.

W. Krämer (A1, A4): So lügt man mit Statistik, Klinik für Gastroenterologie, Hepatologie und Infektiologie, Heinrich-Heine-Universität Düsseldorf, 18.05.2011.

A. Schabert (A4): When is quantitative easing effective?, Federal Reserve Bank of New York, Research Department Seminar, März 2011 (außerdem gehalten: Board of Governors of the Federal Reserve System, Research Department Seminar, Washington D.C. 05.04.2011; Ausschuss für Geldpolitik, Verein für Socialpolitik, Ausschusssitzung 2011, Bundesbank, Frankfurt am Main, 25.02.2011).

A. Schnurr (C5): Some Nice (Counter-)Examples in the Context of Feller and Ito Processes, Thiele Center, Department of Mathematical Sciences, University of Aarhus, 24.03.2011.

A. Schnurr (C5): On a well-balanced Levy driven Ornstein-Uhlenbeck process, Institut für Mathematische Stochastik, TU Braunschweig, 08.02.2011.

D. Wied (A1): Testen auf Änderungen in der Korrelationsstruktur bei unbekanntem Bruchpunkt, Fachgruppe Mathematik, RWTH Aachen, 3.5.2011.

4) Poster

M. Arnold (A1, A4) und D. Wied (A1): Separate estimation of spatial dependence parameters and variance parameters in a spatial model, 1st Conference on Spatial Statistics, 23.03.-25.03.2011, Enschede.

M. Arnold (A1, A4) und D. Wied (A1): Improved GMM estimation of panel data models with spatially correlated error components, 1st Conference on Spatial Statistics, 23.03.-25.03.2011, Enschede.

M. Wendler (C3): Generalized Linear Statistics of Dependent Data, Midwest Statistics Research Colloquium, 18.-19.03.2011, Madison, Wisconsin.

Abschlussarbeiten

M. Draws (C3): Robustheit von Strukturbruchtests bei Zeitreihen, Diplomarbeit, Fakultät Statistik, TU Dortmund, 01.12.2010.

E. Nyabehe (C3): Kontrollkarten für die Prozessvarianz, Masterarbeit, Fakultät Statistik, TU Dortmund, 10.02.2011.

A. Dürre (C3): Über die theoretischen Eigenschaften der Spatial-Sign-Kovarianzmatrix im elliptischen Modell, Bachelorarbeit, Fakultät Statistik, TU Dortmund, 24.01.2011.

M. Klüsener (A1): Typisierung von Bankkunden im Hinblick auf den zu erwartenden Kundennutzen, Bachelorarbeit, Fakultät Statistik, TU Dortmund, 29.04.2011.

Ch. Langesberg (A1): Implementation des Second-order nonlinear least squares-Schätzers, Bachelorarbeit, Fakultät Statistik, TU Dortmund, 08.04.2011.

T. Liboschik (C3): Statistical Analysis of Fluorescence Correlation Spectroscopy, Diplomarbeit, Fakultät Statistik, TU Dortmund, 30.12.2010.

Ch. Rögels (A1): Räumliche Typisierung der Städte und Gemeinden des Landes Nordrhein-Westfalen auf der Grundlage ausgesuchter Merkmale, Diplomarbeit, Fakultät Statistik, TU Dortmund, 28.03.2011.

Promotionen

M. Bücker (A1): Statistische Modelle mit nicht-ignorierbar fehlender Zielgröße und Anwendung in der Reject Inference.

M. Hörmann (A4): Liquidity, interest rates and optimal monetary policy.

Th. Mildenerger (C1): Das Diskrepanzprinzip in der nichtparametrischen Kurvenschätzung.

M. Rieth (A4): Essays on Dynamic Macroeconomics: Debt, Taxation, and Policy Interaction.

Sonstiges

R. Fried (C3) ist Mitglied des Wissenschaftlichen Programmkomitees für den Second Workshop on Integer Valued Time Series, 19.-21.6.2011, Protaras, Zypern.

W. Krämer (A1, A4) ist Mitglied des Programmkomitees für die 100-Jahr-Feier der Deutschen Statistischen Gesellschaft, 20.09.-23.09.2011, Leipzig.

S. Kuhnt (B1) ist Mitglied des Wissenschaftlichen Programmkomitees für die 4th International Conference on Computing and Statistics (ERCIM'11), 17.12.-19.12.2011, Senate House, University of London.

D. Wied (A1) besuchte vom 07.03.-17.03.2011 P. Galeano an der Universidad Carlos III de Madrid zur Zusammenarbeit an dem Projekt "Multiple break detection in the correlation structure of random variables".

Gastwissenschaftler

C. Becker (juristische und wirtschaftswissenschaftliche Fakultät, Martin Luther Universität Halle): Forschungsaufenthalt an der Fakultät Statistik, TU Dortmund, 29.03.-03.04.2011.

S. Hoderlein (Department of Economics, Boston College): Forschungsaufenthalt an der Fakultät Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 12.04.-13.04.2011.

A. Krajina (Institut für Mathematische Stochastik, Universität Göttingen): Vortrag "An M-Estimator of the Multivariate Tail Dependence", 24.05.2011.

E. Mammen (Lehrstuhl für Statistik, Abteilung Volkswirtschaftslehre, Universität Mannheim): Vortrag "Nonparametric Regression with Nonparametrically Generated Covariates", 10.05.2011.

O. Roustant (École Nationale Supérieure des Mines de St-Étienne): Vortrag "Data-Driven Kriging models based on FANOVA decomposition", 15.02.2011.

D. E. Tyler (Department of Statistics, Rutgers University, New Jersey): Vortrag "Robust functional principal components: A projection-pursuit approach", Forschungsaufenthalt an der Fakultät Statistik, TU Dortmund, 09.04.-15.04.2011.

I. van Keilegom (Institut de statistique, Université catholique de Louvain, Louvain-la-Neuve, Belgium): Vortrag "Semi-parametric estimation for dependent right-censoring with an unknown copula", Forschungsaufenthalt an der Fakultät Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 13.04.-18.04.2011.

Workshops, Tagungen

Doktorandentreffen Stochastik 2011, 13.10.-15.10.2011, Ruhr-Universität Bochum.

Organisation mit Hilfe des SFBs: H. Dehling und H. Dette.

<http://www.ruhr-uni-bochum.de/ffm/Lehrstuehle/Lehrstuhl-XII/doktorandentreffen.html>

Conference on New Developments in Econometrics and Time Series, 12.09.-13.09.2011, Solvay Brussels School of Economics and Management, Brüssel.

Organisation mit Hilfe des SFBs: H. Dette und M. Hallin.

[http://www.ecares.org/ecare/personal/veredas\\$/conf_september/conf_september/Home.html](http://www.ecares.org/ecare/personal/veredas$/conf_september/conf_september/Home.html)

10. Workshop on Quality Improvement Methods, 03.-04.06.2011, Haus Villigst, Schwerte.

Organisation für den SFB: J. Kunert und C. Weihs.

<http://www.statistik.tu-dortmund.de/sfb823-workshops.html>

10. Workshop des Student Chapters der Gesellschaft für Energiewissenschaft und Energiepolitik (GEE), 09.-10.05.2011, RWI, Essen.

Organisation für den SFB: M.Frondel und N. Ritter.

<http://www.rwi-essen.de>

Dependence in Probability and Statistics, 04.-08.04.2011, CIRM, Marseille-Luminy.

Organisation mit Hilfe des SFBs: H. Dehling.

http://www.cirm.univ-mrs.fr/Site_test/spip.php?rubrique2&EX=info_rencontre&annee=2011&id_renc=490&lang=fr

Diese Tagung wurde von Herold Dehling (C3, C5) gemeinsam mit Richard Bradley (Bloomington, Indiana), Paul Doukhan (Paris), Michael Neumann (Jena) geleitet. Das CIRM ist ein internationales Tagungszentrum, das von der CNRS (Centre National de la Recherche Scientifique) und der SMF (Société Mathématique de France) gemeinsam getragen wird. Am CIRM finden wöchentlich Tagungen zu einem aktuellen mathematischen Thema statt, die im Stil der Oberwolfach-Tagungen abgehalten werden. Die Tagung Dependence in Probability and Statistics wurde durch eine finanzielle Beihilfe des CIRM ermöglicht. Zusätzliche finanzielle Unterstützung des SFB 823 ermöglichte es, weitere Tagungsteilnehmer einzuladen.

An der Tagung nahmen insgesamt 52 Wissenschaftler teil, die meisten davon aus Frankreich und Deutschland. Es gab 38 Vorträge zu einem breiten Spektrum an Themen, von funktionalanalytischen Methoden zur Untersuchung des stochastischen Verhaltens dynamischer Systeme bis zu Strukturbruchtests in Zeitreihen. Es war das erklärte Ziel der Tagungsleitung, bei dieser Tagung Wahrschein-

lichkeitstheoretiker und Statistiker zusammenzubringen, die an der Entwicklung neuer Techniken zur Modellierung und mathematischen Analyse abhängiger Prozesse oder an deren Anwendung in der Statistik arbeiten, und dabei ein Forum für den Austausch zwischen 'Theoretikern' und 'Praktikern' zu geben. Nach Auffassung aller Tagungsteilnehmer ist das hervorragend gelungen, wozu neben dem wissenschaftlichen Programm sicher auch die einzigartige Atmosphäre dieses Tagungszentrums am Mittelmeer beigetragen hat. Aus dem SFB 823 stellten Roland Fried (C3), Mathias Vetter (A1), Martin Wendler (C3) und Dominik Wied (A1) die Ergebnisse ihrer aktuellen Arbeiten vor.

Diskussionspapiere

- 19/11 R. Fried und H. Dehling (beide C3): Robust nonparametric tests for the two-sample location problem.
- 18/11 M. Frondel und C. Vance (beide A3): Re-identifying the rebound: What about asymmetry?
- 17/11 M. Birke und N. Bissantz (beide C4): Testing for symmetries in multivariate inverse problems.
- 16/11 D. Wied (A1), H. Dehling (C3, C5), M. van Kampen und D. Vogel (C3): A fluctuation test for constant Spearman's rho.
- 15/11 M. Hörmann (A4): Liquidity premia, interest rates and exchange rate dynamics.
- 14/11 Th. Mildenerger und H. Weinert (beide C1): The benchden package: Benchmark densities for nonparametric density estimation.
- 13/11 P. Preuß, M. Vetter und H. Dette (alle A1): Testing semiparametric hypotheses in locally stationary processes.
- 12/11 H. Dette, S. Volgushev (beide A1) und J. Wagener: Nonparametric comparison of quantile curves: a stochastic process approach.
- 11/11 M. Frondel und C. Vance (beide A3): Interpreting the outcomes of two-part models.
- 10/11 M. Erdbrügge, S. Kuhnt und N. Rudak (beide B1): Joint optimization of multiple responses based on loss functions.
- 09/11 H. Dette (A1), S. Hoderlein und N. Neumeyer: Testing multivariate economic restrictions using quantiles: The example of Slutsky negative semidefiniteness.
- 08/11 S. Jäschke, K. F. Siburg und P. A. Stoimenov (A1): Modelling dependence of extreme events in energy markets using tail copulas.
- 07/11 A. Schabert (A4): Exchange rate policy under sovereign default risk.
- 06/11 A. Bücher und H. Dette (beide A1): Multiplier bootstrap of tail copulas – with applications.
- 05/11 Ch. B. Busch und C. Vance (A3): The diffusion of cattle ranching and deforestation: prospects for a hollow frontier in Mexico's Yucatán.
- 04/11 M. Jovanovic (A1): German stock market behavior and the IFO business climate index: a copula-based Markov approach.
- 03/11 Ch. Rothe und D. Wied (A1): Misspecification testing in a class of conditional distributional models.
- 02/11 R. Weißbach, W. Poniatowski und W. Krämer (A1): Smooth estimation of rating transitions by nearest neighbors -Consistency and Application-.

- 01/11 M. Bücker und W. Krämer (A1): Reject inference in consumer credit scoring with nonignorable missing data.
- 50/10 S. Engelke und J. H. C. Woerner (C5): A unifying approach to fractional Lévy processes.

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