

SFB
823

Statistik nichtlinearer dynamischer Prozesse

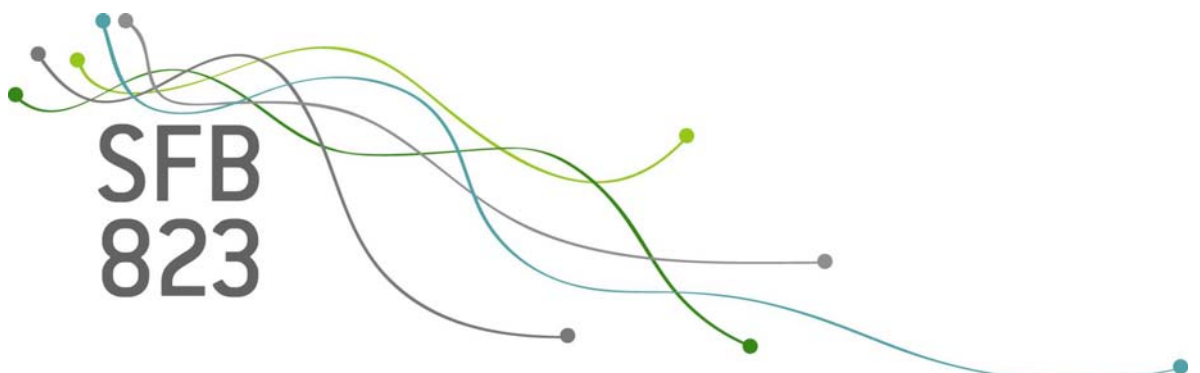
Ausgabe 5

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,

wir sind jetzt in der zweiten Halbzeit von Phase eins unseres schönen Forschungsverbundes. Und wie auch dieser Infobrief wieder zeigt, können sich unsere bisherigen Taten durchaus sehen lassen. Das betrifft in besonderer Weise auch die Infrastruktur unseres Projekts. Denn am 15. November ging unter großer Anteilnahme der Medien unsere SFB-eigene Kinderkrippe offiziell in Betrieb. Das bei der feierlichen Eröffnung am häufigsten erwähnte Wort war „Pilotprojekt“. Darauf bin ich fast so stolz wie auf die vielen wissenschaftlichen Errungenschaften, auf die wir bisher verweisen können; von vielen anderen Standorten kamen Anfragen, wie man denn so etwas auf die Beine stellt.



Nach Weihnachten trifft sich der Vorstand und berät über die Struktur des SFBs in Förderphase 2. Zu großen Änderungen gibt es keinen Anlass, oder wie es unter Fußballtrainern heißt: Never change a winning team. Aber auch gute Dinge kann man besser machen. Ich sehe also Ihren Exposés mit großer Vorfreude entgegen.

Damit schöne Feiertage, und auf ein Neues im neuen Jahr!

Walter Krämer
TU Dortmund
Sprecher des SFB 823

Rufe, Ehrungen und Preise

Holger Dette (A1, C1, C2) hat einen Ruf auf eine Professur für Statistik am University College London erhalten.

B. Franke (ehemals C5) hat zum 01. September 2011 einen Ruf auf eine Professur für Mathematik an der Université de Bretagne Occidental in Brest erhalten und angenommen.

Roland Fried (C3) hat einen Ruf auf die Professur "Statistik" an der Universität Bielefeld erhalten.

Manuel Frondel und **Colin Vance (beide A3)** haben mit der Arbeit "Fixed, Random, or Something in Between? A Variant of HAUSMAN's Specification Test for Panel Data Estimators" (erschienen in: *Economics Letters* 107, 327-329) den 3. Platz des Publikationspreises für das Jahr 2010 der Gesellschaft der Freunde und Förderer des RWI erzielt.

Das Team vom **Teilprojekt B2** hat auf der vom 04.-08.09.2011 stattfindenden ENBIS (European Network for Business and Industrial Statistics) Konferenz an der University of Coimbra, Portugal, den Preis für das beste Poster erhalten.

Stanislav Volgushev (C1) hat für seine herausragende Dissertation den "Dr. Heinrich Kost Preis" der Freunde der Ruhr-Universität Bochum erhalten.

Allen Geehrten und Berufenen: Herzlichen Glückwunsch!

Veröffentlichungen

1) Publikationen in Fachzeitschriften

zur Veröffentlichung angenommen:

U. Alexy, A. Schaefer, O. Sailer, M. Busch-Stockfisch, S. Huthmacher, J. Kunert, (B2, C2) und M. Kersting: Sensory preferences and discrimination ability of children in relation to their body weight status, erscheint in: *Journal of Sensory Studies*.

M. Arnold, S. Stahlberg und D. Wied (alle A1): Modelling different kinds of spatial dependence in stock returns, erscheint in: *Empirical Economics*.

P. Behl, H. Dette, M. Frondel und H. Tauchmann (beide A3): Choice is Suffering: A Focused Information Criterion for Model Selection, erscheint in: *Economic Modelling*.

S. Biedermann, N. Bissantz (C4), H. Dette (A1, C1) und E. Jones: Optimal Designs for Indirect Regression, erscheint in: *Inverse Problems*.

N. Bissantz (C4), H. Dette (C2) und K. Proksch (C4): Model checks in inverse regression models with convolution-type operators, erscheint in: *Scandinavian Journal of Statistics*.

H. Dehling und R. Fried (beide C3), Asymptotic Distribution of Two-sample Empirical U-Quantiles with Applications to Tests for Structural Change, erscheint in: *Journal of Multivariate Analysis*.

H. Dehling, A. Rooch (beide C3) und M. S. Taqqu: Nonparametric Change-Point Tests for Long-Range Dependent Data, erscheint in: *Scandinavian Journal of Statistics*.

H. Dette (C1) und C. Heuchenne: Scale checks in censored regression, erscheint in: *Scandinavian Journal of Statistics*.

H. Dette und T. Hildebrandt (beide A1, C1): A note in testing hypotheses for stationary processes in the frequency domain, erscheint in: *Journal of Multivariate Analysis*.

H. Dette (A1, C1), M. Marchlewski (C1) und J. Wagener: Testing for a constant coefficient of variation in nonparametric regression, erscheint in: *Annals of the Institute of Statistical Mathematics*.

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), K.F. Siburg und P.A. Stoimenov (A1): A copula-based nonparametric measure of regression dependence, erscheint in: *Scandinavian Journal of Statistics*.

M. Frondel (A3), N. Ritter und C. Vance (A3): Heterogeneity in the Rebound: Evidence for German Households, erscheint in: *Energy Economics*.

M. Hallin (C1), I. W. McKeague, S. López-Pintado und M. Šiman: Analyzing growth trajectories, erscheint in: *Journal of Developmental Origins of Health and Disease*.

M. Hallin (C1), Y. Swan, T. Verdebout und D. Veredas: One-step R-estimation in linear models with stable errors erscheint in: *Journal of Econometrics* (special issue on Heavy Tails).

M. Hallin (C1), Ch. Ley: Skew-symmetric distributions and Fisher information: a tale of two densities, erscheint in: *Bernoulli*.

T. Holland-Letz, H. Dette (C2) und D. Renard: Efficient algorithms for optimal designs with correlated observations in pharmacokinetics and dose finding studies, erscheint in: *Biometrics*.

A. Schnurr und J. H. C. Woerner (beide C5): Well-balanced Lévy-driven Ornstein-Uhlenbeck Processes, erscheint in: *Statistics and Risk Modelling*.

M. Vetter (A1, C1): Estimation of correlation for continuous semimartingales, erscheint in: *Bernoulli*.

M. Vetter (A1) und H. Dette (A1, C1): Model checks for the volatility under micro-structure noise, erscheint in: *Bernoulli*.

D. Wied, M. Arnold (beide A1), N. Bissantz (C4) und D. Ziggel: A new fluctuation test for constant variances with applications to finance, erscheint in: *Metrika*.

D. Ziggel, D. Wied (A1): Trading strategies based on new fluctuation tests, erscheint in: *IFTA-Journal*.

Seit dem letzten Infobrief erschienen:

S. Bialonski, M. Wendler (C3) und K. Lehnertz: Unraveling Spurious Properties of Interaction Networks with Tailored Random Networks, *PLoS ONE* 6(8), 2011.

S. Biedermann, H. Dette (C2) und D. C. Woods: Optimal design for additive partially nonlinear models, *Biometrika* 98 (2), 2011, 449-458.

B. Bornkamp, F. Bretz, H. Dette (C2) und J. Pinheiro: Response-adaptive dose-finding under model uncertainty, *Annals of Applied Statistics* 5 (2B), 2011, 1611-1631.

A. Bücher (A1), H. Dette (A1, C1) und S. Volgushev (C1): New estimators of the Pickands dependence function and a test for extreme-value dependence, *Annals of Statistics* 39 (4), 2011, 1963-2006.

M. Bücker, W. Krämer und M. Arnold (alle A1): A Hausman test for non-ignorability, *Economics Letters* 114 (1), 2012, 23-25.

C. B. Busch und C. Vance (A3): The Diffusion of Cattle Ranching and Deforestation: Prospects for a Hollow Frontier in Mexico's Yucatán, *Land Economics* 87 (4), 2011, 682-698.

H. Dehling und R. Fried (beide C3): Asymptotic Distribution of Two-Sample Empirical U-Quantiles with Applications to Robust Tests for Shifts in Location, *Journal of Multivariate Analysis* 105, 2012, 124-140.

H. Dette (C2) und V. B. Melas: A note on the de la Garza phenomenon for locally optimal designs, *Annals of Statistics* 39 (2), 2011, 1266-1281.

H. Dette (A1, C1), P. Preuß und M. Vetter (beide A1): A measure of stationarity in locally stationary processes with applications to testing, *Journal of the American Statistical Association* 106 (495), 2011, 1113-1124.

M. Erdbrügge, S. Kuhnt und N. Rudak (beide B1): Joint optimization of independent multiple responses based on loss functions, *Quality and Reliability Engineering International* 27, 2011, 689-704.

Online: doi: 10.1002/qre.1229

R. Fried und H. Dehling (beide C3), Robust nonparametric tests for the two sample location problem, *Statistical Methods and Applications* 20, 2011, 409-422.

M. Frondel (A3): Modeling Energy and Non-Energy Substitution: A Brief Survey of Elasticities, *Energy Policy* 39 (8), 2011, 4601-4604.

M. Frondel und C. Vance (beide A3): Rarely Enjoyed? A Count Data Analysis of Ridership in Germany's Public Transport, *Transport Policy* 18 (2), 2011, 425-433.

M. Hallin (C1), D. Cassart und D. Paindaveine (C1): A class of optimal tests for symmetry based on Edgeworth approximations. *Bernoulli* 17, 2011, 1063-1094.

M. Hallin (C1) und R. Liska: Dynamic factors in the presence of block structure. *Journal of Econometrics* 163, 2011, 29-41.

M. Hallin (C1), Ch. Mathias, H. Pirotte und D. Veredas: Market liquidity as dynamic factors, *Journal of Econometrics* 163, 2011, 42-50.

M. Hallin (C1), Y. Swan, T. Verdebout und D. Veredas: Rank-based testing in linear models with stable errors, *Journal of Nonparametric Statistics* 23, 2011, 305-320.

M. Hallin, R. van den Akker und B. J. M. Werker: A class of simple semiparametrically efficient rank-based unit root tests, *Journal of Econometrics* 163, 2011, 200-214.

D. Wied (A1), H. Dehling (C3) und W. Krämer (A1): Testing for a change in correlation at an unknown point in time using an extended functional delta method, *Econometric Theory* 29, 2012.

Online: doi: 10.1017/S0266466611000661

2) Veröffentlichungen in Sammelbänden (nur bereits erschienene)

R. Fried (C3), H. El Saied und K. Fokianos: Outliers and Interventions in INGARCH time series, in D. Conesa et al. (Hrsg.): Proceedings of IWSM 2011, Valencia, 234–239.

B. Hussong (B1): Modeling properties of HVOF thermally sprayed WC-Co coatings based on particle-in-flight characteristics, International Thermal Spray Conference 2011, Hamburg, 27.-29.09.2011, DVS-Berichte 276.

N. Raabe, C. Rautert, M. Ferreira und C. Weihs (alle B4): Geometrical Process Modeling and Simulation of Concrete Machining Based on Delaunay Tessellations, Proceedings of the World Congress on Engineering and Computer Science 2011, Vol. II, WCECS 2011, 19.-21.10.2011, San Francisco.

W. Tillmann, D. Biermann, M. Ferreira, C. Rautert, N. Raabe und H. Trautmann (alle B4): Crystal orientation determination of monocrystalline diamond grains for tool application with electron backscatter diffraction (EBSD), Euro PM2011: Proceedings Vol.1, 10.10.2011, Barcelona.

3) Sonstige Veröffentlichungen (nur bereits erschienene)

M. Frondel, N. Ritter und C. Vance (alle A3): Heterogenität des Reboundeffekts: Evidenz für deutsche Haushalte, *Ökonomenstimme*, 2011.

<http://www.oekonomenstimme.org>.

M. Frondel und C. Vance (beide A3): Heterogeneity in the Rebound: Evidence for German Households, *RFF Commentary Series, Resources for the Future, Washington, August 22*.

<http://www.rff.org/Publications/WPC/Pages/Heterogeneity-in-the-Rebound-Evidence-for-German-Households.aspx>

4) Bücher (nur bereits erschienene)

K. Webel und D. Wied (beide A1): Stochastische Prozesse – Verständliche Einführung für Statistiker und Datenwissenschaftler, 2011, Gabler.

5) Patente

Teilprojekt B2: Verfahren zur Herstellung von Verbundwerkstücken mit Verstärkungsstrukturen sowie entsprechend hergestellte Verbundwerkstücke.

Veröffentlichung unter: <http://www.wipo.int/patentscope/search/en/detail.jsf?docId=W02011147387>

Vorträge

1) Eingeladene Haupt- und Plenarvorträge:

Holger Dette (A1, C1, C2): Optimal designs, orthogonal polynomials and random matrices, Jahrestagung der Deutschen Mathematiker Vereinigung, Köln, 19.-22.09.2011.

Holger Dette (A1, C1, C2), Quantile based spectral analysis, Festvortrag zum 100jährigen Bestehen der Deutschen Statistischen Gesellschaft, Leipzig, 19.-23.09.2011.

R. Fried (C3): Robust Methods in Small Area Estimation, Workshop of the ERCIM Working Group on Computing and Statistics, London, 17.-19.12.2011.

W. Krämer (A1, A4): Hysterie als Standortnachteil, 141. Höxberg-Gespräch des Arbeitgeberverbandes Zement und Baustoffe e.V., Beckum, 01.12.2011.

2) Sonstige Vorträge auf Konferenzen:

M. Arnold (A1): Modeling different kinds of spatial dependence in stock returns, Statistische Woche Leipzig, 21.09.2011.

N. Bauer (C2): Comparison of Classical and Sequential Design of Experiments in Note Onset Detection, Joint Conference of the German Classification Society and the German Association of Pattern Recognition (GfKL 2011), Frankfurt a.M., 30.08.-02.09.2011.

M. Borowski (C1): Robust moving window regression for outlier-contaminated data streams, Int. Conference on Robust Statistics 2011, Valladolid, 27.06.-01.07.2011.

C. Bredemeier (A4): Inattentive Voters and Welfare-State Persistence, Jahrestagung des Vereins für Socialpolitik, Frankfurt, 05.09.2011.

C. Bredemeier (A4): Assortative Mating and Female Labor Supply, Jahrestagung des Vereins für Socialpolitik, Frankfurt, 06.09.2011.

A. Dürre (C3): The Fisher consistent transformed spatial sign covariance matrix and its properties, ERCIM, London, 17.-19.12.2011.

A. Dürre und T. Liboschik (beide C3): Robust estimation of the autocorrelation function, IASC Summer School 2011, Leuven, 06.09.2011.

R. Fried und H. Dehling (beide C3): Robust Shift Detection in Time Series, Statistische Woche 2011, Leipzig, 19.-22.09.2011.

R. Fried (C3), H. El Saied und K. Fokianos: Outliers and Interventions in INGARCH time series, International Workshop on Statistical Modelling IWSM, Valencia, 10.-13.07.2011.

M. Frondel (A3): Rarely Enjoyed? A Count Data Analysis of Ridership in Germany's Public Transport, 34th International IAEE Conference: Institutions, Efficiency and Evolving Energy Technology (IAEE 2011), Stockholm, 19.-23.06.2011.

B. Hussong (B1): Modeling properties of HVOF thermally sprayed WC-Co coatings based on particle-in-flight characteristics, International Thermal Spray Conference 2011, Hamburg, 27.-29.09.2011.

F. Jüßen (A4): Understanding Default Risk Premia on Public Debt, Verein für Socialpolitik, Frankfurt, 05.09.2011.

F. Jüßen (A4): Understanding Default Risk Premia on Public Debt, 10th Budapest Macroeconomic Policy Research Workshop on "Fiscal rebalancing, public debt, and its national and global implications" (CEPR with Magyar Nemzeti Bank), Budapest, 15.09.2011.

T. Kley: A Quantile-Based Approach to Spectral Analysis of Time Series, Conference on New Developments in Econometrics and Time Series, Brüssel, 12.-13.09.2011.

S. Kuhnt (B1), Algebraic identifiability and comparison of generalised linear models, Workshop Algebraic Method in Experimental Design, Cambridge, Großbritannien, 26.-27.10.2011.

J. Kunert (C2): Unreplicated fractional factorials, analysis with the half-normal plot and randomization of the run order, Optimal Design of Experiments - Theory and Application, Wien, 25.-30.09.2011.

T. Liboschik (C3): Interventions in INGARCH processes and their effects on the estimation of autocorrelation, ERCIM, London, 17.-19.12.2011.

O. Melsheimer (C2): Block designs with AR (1)-correlated errors for the comparison of treatments with a control, Optimal Design of Experiments - Theory and Application, Wien, 25.-30.09.2011.

P. Preuß (C1): A measure of stationarity in locally stationary processes, 17. DStatG-Nachwuchs-Workshop, Leipzig, 19.-20.09.2011.

P. Preuß (C1): A measure of stationarity in locally stationary processes, Conference on New Developments in Econometrics and Time Series, Brüssel, 12.09-13.09.2011.

K. Proksch (C4): Model Checks in Inverse Regression Models with Convolution-Type Operators, 9th International Conference of Numerical Analysis and Applied Mathematics, Chalkidiki, 19.09-25.09.2011.

N. Raabe (B4): Geometrical Process Modeling and Simulation of Concrete Machining Based on Delaunay Tessellations, World Congress on Engineering and Computer Science 2011, WCECS 2011, San Francisco, 19.-21.10.2011.

N. Ritter (A3): Heterogeneity in the Rebound: Further Evidence for Germany, European Association of Environmental and Resource Economists (EAERE 2011), Rom, 29.06.-02.07.2011.

A. Rooch (C3): Nonparametric Change-Point Tests for Long-Range Dependent Data, Statistische Woche 2011, Universität Leipzig, 20.-23.09.2011.

N. Rudak (B1), R-Package JOP: Optimization of Multiple Responses, UseR! 2011, Warwick, 16.-18.08.2011.

A. Schabert (A4): When is quantitative easing effective?, Jahrestagung des Vereins für Socialpolitik, Frankfurt, 06.09.2011.

A. Schabert (A4) When is quantitative easing effective? Workshop Current Macroeconomic Challenges, Bundesbank/Banque de France, 18.05.2011.

A. Schnurr (C5): On the Semimartingale Nature of Feller Processes with Killing, 8th congress of the ISSAC, People's Friendship Univ. Moscow, 24.08.2011.

M. van Kampen (A1): A nonparametric constancy test for copulas under mixing conditions, North American Summer Meeting of the Econometric Society, St. Louis, 09.-12.06.2011.

M. Vetter (A1, C1): Covariation Estimation for Multivariate Continuous Itô Semimartingales With Noise, Statistical Methods For Dynamical Stochastic Models, Heidelberg, 16.-18.07.2011.

S. Volgushev (C1): Residual-based inference for nonparametric quantile regression, International Conference on Robust Statistics, Valladolid, 27.06.-01.07.2011.

S. Voß (A1): A Score-Test on Measurement Errors in Rating Transitions, Statistische Woche Leipzig, 20.-23.09.2011.

H. Weinert (B1): The benchden Package: Benchmark Densities for Nonparametric Density Estimation, UseR! 2011, Warwick, 16.-18.08.2011.

M. Wendler (C3): Strong invariance principle for the generalized quantile process under dependence, DMV-Tagung, Köln, 19.-22.09.2011.

J. Woerner (C5): Modelling correlation in financial data: fractional Lévy processes and well-balanced Ornstein-Uhlenbeck processes, 7th Seminar on Stochastic Analysis, Random Fields and Applications, Ascona, 23.-27.05.2011.

J. Woerner (C5): Modelling and inference of the correlation structure in continuous time stochastic processes, ISI Satellite meeting, Kopenhagen, 17.-19.08.2011.

J. Woerner (C5): Modelling correlation in high frequency data: the well-balanced Ornstein-Uhlenbeck process, Statistische Woche Leipzig, 20.-23.09.2011.

3) Vorträge in Fakultätsseminaren:

A. Bücher (A1): New estimators of the Pickands dependence function and a test for extreme-value dependence, Université catholique de Louvain, 21.10.2011.

H. Dehling (C3, C5): New Techniques for Empirical Processes of Dependent Data, Séminaire Analyse et Probabilités, Université de Bretagne Occidentale, Brest, 03.11.2011.

H. Dehling (C3, C5): Asymptotic Distribution of Two-Sample Empirical U-Quantiles for Dependent Data. Stochastisches Minikolloquium, Universität Osnabrück, 11.11.2011.

F. Jüßen (A4): Assortative Mating and Female Labor Supply, Queen Mary University of London, 17.10.2011.

J. Kunert (C2): A-optimal block designs for the comparison with a control in the presence of correlated errors. School of Mathematics and Statistics, University of Glasgow, 21.10.2011 (außerdem: School of Mathematics, University of Edinburgh, 28.10.2011).

A. Schabert (A4): A Monetary Analysis of Balance Sheet Policies, Paris School of Economics, 01.12.2011.

A. Schnurr (C5): Well-balanced Lévy Driven OU Processes: Properties and Applications. TU Kaiserslautern, 30.11.2011.

S. Volgushev (C1): Censoring and Penalization for Regression Quantiles, University of Illinois at Urbana-Champaign, 15.09.2011.

4) Poster

A. Bücher (A1): Multiplier Bootstrap Approximations of Tail Copulas, Workshop on Copula Models and Dependence, Montreal, 06.-09.06.2011.

R. Fried (C3), I. Aguesop, B. Bornkamp, K. Fokianos, J. Fruth und K. Ickstadt: Bayesian Outlier Detection in INGARCH Time Series, 7th Workshop on Bayesian Inference for Stochastic Processes BISP 2011, Madrid, 01.-03.09.2011.

O. Melsheimer, J. Kunert, G. Sebastiani, A. E. Tekkaya, S. Wenzel und A. Wilk (alle B2): Quantification of sheet thickness from optical measurements, ENBIS conference, Coimbra, 05.-07.09.2011.

P. Preuß (C1): A measure of stationarity in locally stationary processes, Econometric and Statistical Modelling of Multivariate Time Series, Louvain-la-Neuve, 25.-27.05.2011. (außerdem: 2nd NTH workshop on finance and insurance mathematics, Braunschweig, 30.06.-02.07.2011; Young Statisticians Meeting, Trinity College Dublin, 19.-21.08.2011).

C. Rautert (B4): Zerspanung mineralischer Untergründe, 30. Hager Symposium der Pulvermetallurgie, Hagen, 24.-25.11.2011.

Abschlussarbeiten

O. Brede (C5): Anwendung des "minimal statistical noise estimators" auf Hochfrequenzdaten, Diplomarbeit, Fakultät für Mathematik, TU Dortmund, 29.08.2011.

F. Dai (B4): Herstellung und Einsatzversuche von HIP-gesinterten Diamantwerkzeugen zur Zerspanung von Mineralguss, Diplomarbeit, Fakultät Maschinenbau, TU Dortmund, 18.02.2011

T. Fiebig (A1): Eine alternative Validierungsmethode für Ratingmodelle im Bereich der low-default Portfolios bei der WESTLB AG, Diplomarbeit, Fakultät Statistik, TU Dortmund, 08.09.2011.

S. Herrmann (C3): Segmentierung von Fluoreszenzmikroskopie Zeitreihen, Diplomarbeit, Fakultät Statistik, TU Dortmund, 23.09.2011.

Laura Hoyden (B1): Wahl einer geeigneten Linkfunktion im generalisierten linearen Modell mit Anwendung auf einen thermodynamischen Spritzprozess, Bachelorarbeit, TU Dortmund, Fakultät Statistik, 29.08.2011.

F. Kaposty (C5): Modellierung von Korrelationen in Stochastischen Volatilitätsmodellen mit dem Bjerksund-Kern, Bachelorarbeit, Fakultät für Mathematik, TU Dortmund, 10.8.2011.

R. Kawka (C5): Modellierung des Leverage-Effektes in Stochastischen Volatilitätsmodellen, Bachelorarbeit, Fakultät für Mathematik, TU Dortmund, 31.8.2011.

N. Pfaff (A1): Qualitätsvergleich verschiedener Modelle zur Erklärung von Aktienrenditen in Bezug auf Risikomaße, Diplomarbeit, Fakultät Statistik, TU Dortmund, 17.06.2011.

T. Priggemeier (B1), Einfluss der Spritzparameter auf die Splatbildung beim HVOF thermischen Spritzen von WC-12Co, Bachelorarbeit, Fakultät Maschinenbau, TU Dortmund, 18.08.2011.

R. Puchstein (A1): Empirische Spektralprozesse und ihre Anwendung in der Zeitreihenanalyse, Diplomarbeit, Fakultät für Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 27.06.2011.

M. Terhürne (A1): Robuste Zusammenhangsmaße im hochdimensionalen Datensatz, Bachelorarbeit, Fakultät Statistik, TU Dortmund, 05.09.2011.

Promotionen

A. Bücher (A1): Statistical Inference for Copulas and Extremes.

O. Melsheimer (C2): A-optimale Blockpläne für Behandlungs-Kontroll-Vergleiche bei AR(1)-korrelierten Fehlern.

N. Raabe (B4): Physikalisch-Statistische Modellierung von Biegeschwingungen.

R. Walter (A1): Dynamische Frailties in Zählprozessen mit Anwendung auf Ratingmigrationen.

M. Wendler (C3): Empirical U-Quantiles of Dependent Data.

S. Wenzel (B2): Sequential multi-objective target value optimization.

Sonstiges

C. Bredemeier (A4) und D. Wied (A1) wurden ausgewählt, am 4. Lindauer Treffen der Nobelpreisträger in Wirtschaftswissenschaften (23.-27.8.2011) teilzunehmen.

Herold Dehling (C3, C5) ist Vorsitzender des Scientific Programme Committee der German Probability and Statistics Days, Mainz, 06.-09.03.2012.

Herold Dehling (C3, C5) ist Vorsitzender des Scientific Programme Committee der German-Polish Joint Conference on Probability and Mathematical Statistics, Torun, im Juni 2013.

R. Fried (C3) leitet als Conference Co-Chair den Track "Time Series Modelling and Computation" auf dem Workshop der ERCIM Working Group on Computing and Statistics, London, 17.-19.12.2011.

C. Hankeln (C5) hat den Frommknechtpreis für ihre Bachelorarbeit "Zeitreihen mit Langzeitabhängigkeiten" am 01.12.2011 erhalten.

J. Kunert (C2) ist Mitglied des Wissenschaftlichen Programmkomitees für die 12^{èmes} Journées Européennes Agro-Industrie et Méthodes Statistiques, Paris, France, 29.02.-02.03.2012.

A. Schabert (A4) besucht von September 2011 bis Februar 2012 mehrmals im Rahmen des Forschungsprojekts "Balance sheet policies of the European Central Bank" die Europäische Zentralbank (Monetary Policy Research Division).

J. Woerner (C5) ist Mitglied der Jury des Förderpreises 2012 der Fachgruppe Stochastik.

Gastwissenschaftler

I. Berkes (Institute of Statistics, Graz University of Technology): Vortrag "Some recent results in strong approximation theory", 18.11.2011.

M. Bibinger (Institut für Mathematik, Humboldt-Universität zu Berlin): Vortrag "Estimating the quadratic covariation of non-synchronously observed Itô processes", 11.07.2011.

S. Biedermann (School of Mathematics, University of Southampton): Forschungsaufenthalt an der Fakultät Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 30.06-04.07.2011.

S. Delvaux (Katholieke Universiteit Leuven): Forschungsaufenthalt an der Fakultät Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 12.07-13.07.2011.

P. Fryzlewicz (Department of Statistics, London School of Economics): Vortrag "Time-Threshold Maps: using information from wavelet reconstructions with all threshold values simultaneously", 08.11.2011.

C. Heuchenne (Statistique appliquée à la gestion et à l'économie, Université de Liège): Forschungsaufenthalt an der Fakultät Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 09.-20.07.2011.

R. Ibragimov (Department of Economics, Harvard University): Forschungsaufenthalt an der Fakultät Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 13.07.2011.

C. Jentsch (Abteilung Volkswirtschaftslehre, Universität Mannheim): Vortrag "Testing equality of spectral densities using randomization techniques", 22.11.2011.

R. Korn (Fachbereich Mathematik, Technische Universität Kaiserslautern): Vortrag "Optimale Portfolios bei Crash-Gefahr", 31.05.2011.

T. Ledwina (Institut für Mathematik der Polnischen Akademie der Wissenschaften, Warschau): Forschungsaufenthalt an der Fakultät Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 27.-30.09.2011.

D. McCloskey (Department of Economics, University of Illinois at Chicago): Vortrag "The Bankruptcy of Statistical Fit as a Measure of Importance", 13.12.2011.

V. B. Melas (Faculty of Mathematics & Mechanics, St. Petersburg State University): Forschungsaufenthalt an der Fakultät Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 01.06.-29.06.2011.

W. Niemiro (Uniwersytetu Warszawskiego, Torun): Forschungsaufenthalt an der Fakultät Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 28.09.-30.09.2011.

M. Reiß (Lehrstuhl für Mathematische Statistik, Humboldt-Universität zu Berlin): Vortrag "Efficient volatility estimation under microstructure noise", 29.09.2011.

E. Riccomagno (Dipartimento di Matematica, Università di Genova): "Chain event graphs", 19.07.2011.

T. Rolski (University of Wrocław): Forschungsaufenthalt an der Fakultät Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 27.09.-30.09.2011.

Johann Segers (Institut de statistique, biostatistique et sciences actuarielles, Université catholique de Louvain): Forschungsaufenthalt an der Fakultät Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 21.06-22.06.2011.

N. Serdyukova (Université de Provence, LATP-CMI, Marseille): "Spatial and structural adaption", 04.07.2011.

J. A. Wellner (Department of Statistics, University of Washington): "Nonparametric estimation of log-concave densities", 15.11.2011.

Workshops, Tagungen

Design and Analysis of Experiments, 18.07.-21.12.2011, Isaac Newton Institute for Mathematical Sciences, Cambridge, Großbritannien.

Organisation: H. Dette (C1).

<http://www.newton.ac.uk/programmes/DAE/>

Robust methods for dependent data, 26.-29.02.2012, Lukas-Zentrum, Witten.

Organisation: R. Fried (C3), S. Kuhnt (B1), Ch. Müller.

<http://www.statistik.tu-dortmund.de/1573.html>

Time Series Modelling: Breaks and Applications, 01.02.-03.02.2012, Karlsruher Institut für Technologie.

Organisation: R. Fried, H. Dehling (beide C3) und C. Kirch (KIT).

<http://ts-mba.math.kit.edu/>

DoktorandInnentreffen Stochastik 2011, 13.-15.10.2011, Ruhr-Universität Bochum

Organisation: K. Prosch und M. Tusche

Das ist eine jährliche Konferenz von und für Doktorandinnen und Doktoranden der Stochastik in Deutschland, Österreich und der Schweiz, mit dem Ziel, Promovierende von möglichst vielen verschiedenen Universitäten anzusprechen.

Jeder der 55 Teilnehmenden hatte die Möglichkeit seine Forschungsgebiete und -ergebnisse in kurzen Vorträgen vorzustellen und einen Überblick über die Arbeitsgebiete anderer Doktoranden zu gewinnen und auch die Bildung von Netzwerken als ein essentielles Anliegen des Treffens kam nicht zu kurz.

SFB-Akademie

S. Kuhnt und **H. Weinert (beide B1)** haben einen zweitägigen Intensivkurs "Einführung in die statistische Versuchsplanung" organisiert.

In der Leitung der Akademie hat es einen Wechsel gegeben: Ronja Walter (seit September Dr. Ronja Walter, herzlichen Glückwunsch!) hat ein Angebot der Banco Santander erhalten und verlässt uns zum 1. Januar 2012 Richtung Frankfurt. Ihre Aufgaben als Organisator der SFB-Akademie übernimmt Sebastian Voss aus dem Projekt A1.



Sebastian Voss ist derzeit noch Mitglied des Dortmunder Graduiertenkollegs „Angewandte Statistik“ und wird im Frühjahr 2012 seine Doktorarbeit über das heiße Thema Kreditbewertungen abschließen. Über Vorschläge und Anregungen zur konkreten Ausgestaltung des Akademieprogramms freut er sich sehr.



Diskussionspapiere

- 51/11 O. Melsheimer, G. Sebastiani, S. Wenzel, A. E. Tekkaya und J. Kunert (alle B2): Aufbereitung von optischen Messdaten zur Analyse der asymmetrischen inkrementellen Blechumformung (AIBU).
- 50/11 K. Christensen, M. Podolskij und M. Vetter (A1): On covariation estimation for multivariate continuous Itô semimartingales with noise in non-synchronous observations schemes.
- 49/11 M. Vetter (A1): Estimation of integrated volatility of volatility with applications to goodness-of-fit testing.
- 48/11 W. Krämer (A1) und P. Messow: Structural change and spurious persistence in stochastic volatility.
- 47/11 H. Dette, M. Hallin, T. Kley und S. Volgushev (alle C1): Of copulas, quantiles, ranks and spectra an L_1 -approach to spectral analysis.
- 46/11 D. Braess und H. Dette (C2): Optimal discriminating designs for several competing regression models.
- 45/11 D. Belomestny (A6) und V. Panov: Abelian theorems for stochastic volatility models with application to the estimation of jump activity of volatility.
- 44/11 A. Bücher (A1) und S. Volgushev (C1): Empirical and sequential empirical copula processes under serial dependence.
- 43/11 R. Gralla und K. Kraft (beide A5): Separating introduction effects from selectivity effects: The differences in employment patterns of co-determined firms.
- 42/11 R. Gralla und K. Kraft (beide A5): Betriebsräte, Überbeschäftigung und überhöhte Löhne - Eine Bewertung aus Sicht des Arbeitgebers.
- 41/11 M. Frondel und C. Vance (beide A3): Heterogeneity in the effect of home energy audits: Theory and evidence.
- 40/11 G. N. F. Weiß: On the robustness of goodness-of-fit tests for copulas.
- 39/11 H. Dette (C2), A. Pepelyshev und A. Zhigljavsky: Optimal design for linear models with correlated observations.
- 38/11 J. Kunert und A. Wilk (beide C2): Unreplicated fractional factorials, analysis with the half-normal plot and randomization of the run order.
- 37/11 H. Dette (C2), C. Kiss (C2), N. Benda und F. Bretz: Optimal designs for dose finding studies with an active control.
- 36/11 P. Preuß (C1), M. Vetter und H. Dette (beide A1, C1): A test for stationarity based on empirical processes.
- 35/11 A. Bücher (A1), H. Dette und S. Volgushev (beide A1, C1): A test for Archimedeanity in bivariate copula models.
- 34/11 P. Preuß (C1) und T. Hildebrandt (A1, C1): Comparing spectral densities of stationary time series with unequal sample sizes.

- 33/11 M. Frondel und C. Vance (beide A3): Future pain at the diesel pump? Potential effects of the European Commission's energy taxation proposal.
- 32/11 W. Krämer (A1): Das Signifikanztest-Ritual und andere Sackgassen des Fortschritts in der Statistik.
- 31/11 P. Galeano und D. Wied (A1): Multiple break detection in the correlation structure of financial returns.
- 30/11 D. Wied (A1): CUSUM-type testing for changing parameters in a spatial autoregressive model of stock returns.
- 29/11 M. Arnold und D. Wied (beide A1): Improved GMM estimation of panel data models with spatially correlated error components.
- 28/11 M. Borowski (C1) und R. Fried (C3): Robust repeated median regression in moving windows with data-adaptive width selection.
- 27/11 H. Dehling, A. Rooch (beide C3) und M. S. Taqqu: Nonparametric change-point tests for long-range dependent data.
- 26/11 H. Dette und M. Trampisch (beide C2): Optimal designs for quantile regression models.
- 25/11 H. Tauchmann (A3): Partial frontier efficiency analysis for Stata (download software).
- 24/11 N. Bauer, J. Schiffner und C. Weihs (alle C2): Comparison of classical and sequential design of experiments in note onset detection.
- 23/11 H. Dette (C2), V. B. Melas und P. Shpilev: T-optimal designs for discrimination between two polynomial models.
- 22/11 P. Behl, H. Dette (A1, C1), M. Frondel (A3) und H. Tauchmann (A3): Being focused: When the purpose of inference matters for model selection.
- 21/11 J. Wagener und H. Dette (beide C1): The adaptive Lasso in high dimensional sparse heteroscedastic models.
- 20/11 J. Wagener und H. Dette (beide C1): Bridge estimators and the adaptive Lasso under heteroscedasticity.

Alle Diskussionspapiere zum Herunterladen unter:

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



