

SFB
823

Statistik nichtlinearer dynamischer Prozesse

Ausgabe 6

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: walterk@statistik.tu-dortmund.de

Info-Brief



SFB
823

Liebe Freunde, Förderer, Projektleiter und Mitarbeiter des SFB 823,

unser Vorantrag für die zweite Förderphase ist in der Post, der eigentliche Antrag folgt im Herbst. Und wenn ich unsere in diesem Infobrief zusammengestellten Ergebnisse der letzten Monate betrachte, sehe ich einer weiteren Förderung mit Zuversicht entgegen. Die Quantität stimmt sowieso, und angesichts der vielen Auszeichnungen, darunter auch Publikationszusagen in Topjournals aller Art, die von SFB-Projektleitern und -Mitarbeitern in den letzten Monaten eingesammelt werden konnten, scheint auch die Qualität zu passen.

Aber auch die immer zahlreicheren Beiträge von SFB-Projektleitern und -Mitarbeitern in Publikumszeitschriften oder Radiosendungen sind hier zu nennen. Denn gut zu sein alleine reicht nicht aus: Das allgemeine Publikum, das heißt der Steuerzahler, der uns letztendlich finanziert, will wissen, was mit seinem Geld geschieht. Hier danke ich besonders unserem Pressesprecher Aeneas Rooch für sein gutes Händchen bei der Vermittlung der in unserem SFB erzielten Resultate.

Sobald die neuen Richtlinien der DFG zur Formulierung von Fortsetzungsanträgen vorliegen, erhalten Sie von mir Bescheid, dann kann es im Sommer ans Antragschreiben gehen. Bis dahin wünsche ich uns allen noch ein halbwegs stressfreies Semesterende und frohes kreatives Schaffen hinterher.

Ihr

Walter Krämer

TU Dortmund

Sprecher des SFB 823



Unser stellvertretender SFB-Sprecher Holger Dette (links außen) mit dem Sprecher des befreundeten SFB 649, Wolfgang Härdle (2. von rechts), und den Gästen Yakov Ritov (2. von links) und Ming Yuan (rechts außen) bei einer gemeinsamen Tagung in Kloster Drübeck, 29.04.-01.05.2012.

Rufe, Ehrungen und Preise

Melanie Birke (C4), Holger Dette (A1, C1) und Kristin Stahljans haben für ihre Arbeit "Testing symmetry of a nonparametric bivariate regression function" den Journal of Nonparametric Statistics 2011 Best Paper Award erhalten. Die Autoren schlagen in dieser Arbeit einen Symmetrietest für eine nichtparametrische Regressionsfunktion mit einem bivariaten Prädiktor vor und wenden diesen bei der Aufdeckung von Asymmetrien in Graustufenbilder an.

Marc Hallin (C1) hat einen der begehrten, mit 60.000 € dotierten Humboldt-Forschungspreise erhalten. Damit werden Wissenschaftler für ihr bisheriges Gesamtschaffen ausgezeichnet, deren grundlegende Entdeckungen, Erkenntnisse oder neue Theorien das eigene Fachgebiet nachhaltig geprägt haben und von denen auch in Zukunft weitere Spitzenleistungen erwartet werden können. Marc Hallin wird einen Teil des Preisgeldes darauf verwenden, in der zweiten Förderphase weiter mit dem SFB zu kooperieren.



Wolfgang Leininger (A5) und Kai A. Konrad (Max-Planck-Institut für Steuerrecht und Öffentliche Finanzen, München) haben für Ihre gemeinsame Arbeit "Self-enforcing norms and efficient non-cooperative actions in the provision of public goods" den Duncan Black Prize 2011 für den besten Forschungsartikel des Jahres 2011 im Bereich der Public Choice Theorie erhalten. Die Arbeit erklärt, wie soziale Normen in verstaatlichten Gesellschaften oder Gruppen, in denen die einzelnen Mitglieder nur schwer bindende Verträge miteinander schließen können, helfen, innere Verteilungskonflikte zu lösen und den Konflikten mit äußeren Konkurrenten kollektives Handeln effizient zu koordinieren. Die Autoren erhielten den Preis im März auf dem zweiten Weltkongress der Public Choice Society in Miami, USA.

Colin Vance und Manuel Frondel (beide A3) haben mit Ihrem Papier "Re-identifying the rebound: What about asymmetry?" den USAEE/IAEE 2011 Working Paper Best Paper Award der International Association for Energy Economics gewonnen. In der Arbeit geht es darum, dass sich die Energiekosten privater Haushalte auf zwei Arten ändern können: Durch Variation der Preise oder durch Variation der Effizienz der energieverbrauchenden Geräte. Braucht ein Auto nur noch fünf statt vorher zehn Liter Benzin auf 100 Kilometer, reduziert sich der Preis pro Kilometer ganz beträchtlich und die Leute fahren mehr, das heißt auch Rebound-Effekt. Im Papier geht es darum, die Effekte echter Preisänderungen von indirekten Preisänderungen durch Effizienzvariationen zu unterscheiden.

Allen Geehrten: Herzlichen Glückwunsch von allen Kolleginnen und Kollegen im SFB.

Veröffentlichungen

1) Publikationen in Fachzeitschriften

zur Veröffentlichung angenommen:

C. Bayer und F. Jüßen (A4): On the Dynamics of Interstate Migration: Migration Costs and Self-Selection, erscheint in: *Review of Economic Dynamics*.

C. Bredemeier und F. Jüßen (beide A4): Assortative Mating and Female Labor Supply, erscheint in: *Journal of Labor Economics*.

A. Bücher und H. Dette (beide A1): Multiplier bootstrap of tail copulas - with applications, erscheint in: *Bernoulli*.

A. Bücher (A1), H. Dette (A1, C1) und S. Volgushev (C1): A test for Archimedeanity in bivariate copula models, erscheint in: *Journal of Multivariate Analysis*.

H. Dette (C2), B. Bornkamp und F. Bretz: On the efficiency of two-stage response-adaptive designs, erscheint in: *Statistics in Medicine*.

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

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 designs for composed models in pharmacokinetic-pharmacodynamic experiments, erscheint in: *Journal of Pharmacokinetics and Pharmacodynamics*.

H. Dette (C4) und K. Sen (C4): Goodness-of-fit tests in long-range dependent processes under fixed alternatives, erscheint in *ESAIM: P&S*.

H. Dette (A1, C1), K.F. Siburg und P.A. Stoimenov (A1): A copula-based non-parametric measure of regression dependence, erscheint in: *Scandinavian Journal of Statistics*.

H. Dette (C2) und M. Trampisch: Optimal designs for quantile regression models, erscheint in: *Journal of the American Statistical Association*.

H. Dehling (C3, C5), A. Rooh (C3) und M.S. Taqqu: Nonparametric Change-Point Tests for Long-Range Dependent Data, erscheint in: *Scandinavian Journal of Statistics* 39.

S. Engelke und J.H.C. Woerner (C5): A unifying approach to fractional Lévy processes, erscheint in: *Stochastics and Dynamics*.

S. Felder und H. Tauchmann (A3), Federal State Differentials in the Efficiency of Health Production: An Artifact of Spatial Dependence?, erscheint in: *European Journal of Health Economics*.

K. Fokianos und R. Fried (C3): Interventions in log-linear Poisson Autoregression, erscheint in: *Statistical Modelling*.

J. Franke (A5), C. Kanzow, W. Leininger (A5) und A. Schwartz: Effort Maximization in Asymmetric Contest Games with Heterogeneous Contestants, erscheint in: *Economic Theory*.

M. Frondel und C. Vance (beide A3): On interaction effects: The case of Heckit and Two-Part models, erscheint in: *Jahrbücher für Nationalökonomie und Statistik*.

K. Hainke, J. Rahnenführer und R. Fried (C3): Disease progression models: a review and comparison, erscheint in: *Biometrical Journal*.

F. Jüßen und L. Linnemann (beide A4): Markups and Fiscal Transmission in a Panel of OECD countries, erscheint in: *Journal of Macroeconomics*.

L. Linnemann und A. Schabert (beide A4): Fiscal Rules, Interest Payments on Debt, and the Irrelevance of the Taylor Principle, erscheint in: *Scottish Journal of Political Economy*.

A. Schnurr (C5): Generalization of the Blumenthal-Gettoor Index to the Class of Homogeneous Diffusions with jumps and some Applications, erscheint in: *Bernoulli*.

H. Tauchmann (A3): Partial Frontier Efficiency Analysis, erscheint in: *Stata Journal*.

H. Tauchmann (A3), S. Göhlmann, T. Requate und C.M. Schmidt (A3): Tobacco and Alcohol: Complements or Substitutes? A Structural Model Approach to Insufficient Price Variation in Individual-Level Data, erscheint in: *Empirical Economics*.

C. Vance und N. Ritter (beide A3): The Phantom Menace of Omitted Variables: A Comment, erscheint in: *Conflict, Management and Peace Science*.

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

J. Wagener, S. Volgushev (C1) und H. Dette (C1): The quantile process under random censoring, erscheint in: *Mathematical Methods of Statistics*.

R. Weißbach, W. Poniatowski und W. Krämer (A1): Nearest Neighbor Hazard Estimation with Left-Truncated Duration Data, erscheint in: *AStA Advances in Statistical Analysis*.

D. Wied (A1), P. Galeano: Monitoring correlation change in a sequence of random variables, erscheint in: *Journal of Statistical Planning and Inference*.

Seit dem letzten Infobrief erschienen:

P. Behl, H. Dette (beide C1), M. Frondel und H. Tauchmann (beide A3): Choice is Suffering: A Focused Information Criterion for Model Selection, *Economic Modelling* 29 (3), 817-822, (2012).

S. Biedermann, N. Bissantz (C4), H. Dette (C1) und E. Jones: Optimal Designs for Indirect Regression, *Inverse Problems* 27 (10), 105003, (2011).

M. Birke und N. Bissantz (beide C4): Testing for symmetries in multivariate inverse problems, *Journal of Multivariate Analysis*, 236-253, (2012).

- N. Bissantz (C4), H. Dette (C1) und K. Proksch (C4): Model checks in inverse regression models with convolution-type operators, *Scandinavian Journal of Statistics* 39, 305-322, (2012).
- A. Bücher (A1), H. Dette (C1) und G. Wieczorek: Testing model assumptions in functional regression models. *Journal of Multivariate Analysis* 102, 1472-1488, (2011).
- L. Davies, Ch. Höhenrieder und W. Krämer (A1, A4): Recursive computation of piecewise constant volatilities, *Computational Statistics and Data Analysis* 56, 3623-3631, (2012).
- H. Dette und T. Hildebrandt (beide A1, C1): A note in testing hypotheses for stationary processes in the frequency domain, *Journal of Multivariate Analysis* 104, 101-114, (2012).
- H. Dette (C2), V.B. Melas und P. Shpilev: T -optimal designs for discrimination between two polynomial models. *Annals of Statistics* 40 (1), 188-205, (2012).
- H. Dette (C2), A. Pepelyshev und W.K. Wong: Optimal experimental design strategies for detecting hormesis, *Risk Analysis: An International Journal* 31 (12), 1949-1960, (2011).
- J. Franke (A5): Affirmative Action in Contest Games, *European Journal of Political Economy* 28 (1), 105-118, (2012).
- J. Franke (A5): The Incentive Effects of Leveling the Playing Field - An Empirical Analysis of Amateur Golf Tournaments, *Applied Economics* 44 (9), 1193-1200, (2011).
- M. Frondel, N. Ritter und C. Vance (alle A3): Heterogeneity in the Rebound: Further Evidence for Germany, *Energy Economics* 34, 461-467, (2012).
- M. Frondel und C. Vance: Interpreting the Outcomes of Two-Part Models, *Applied Economics Letters* 19 (10), 987-992, (2012).
- T. Holland-Letz, H. Dette (C2) und D. Renard: Efficient algorithms for optimal designs with correlated observations in pharmacokinetics and dose finding studies, *Biometrics* 68 (1), 138-145, (2012).
- W. Krämer (A1): The human sex odds at birth after the atmospheric atomic bomb tests, after Chernobyl, and in the vicinity of nuclear facilities: Comment, *Environmental Policy and Pollution Research* 19 (4), 1332-1334, (2012).
- L. Linnemann und A. Schabert (beide A4): Optimal government spending with labor market frictions, *Journal of Economic Dynamics and Control* 36, 795-811, (2012).
- A. Schabert (A4): Exchange rate policy under sovereign default risk, *Economics Letters* 112, 179-181, (2011).
- A. Schnurr und J.H.C. Woerner (beide C5): Well-balanced Lévy driven Ornstein-Uhlenbeck processes, *Statistics and Risk Modelling* 28, 343-357, (2011).

G. Sebastiani, A. Wawrosch, V. Franzen, A. Brosius und A.E. Tekkaya (alle B2): FlexDie: A Flexible Tooling-Concept for Incremental Sheet Forming, *Key Engineering Materials* 504-506, 883-888, (2011).

O. Sh. Sharipov und M. Wendler (C2): Bootstrap for the sample mean and for U-statistics of mixing and near-epoch dependent processes, *Journal of Non-parametric Statistics* 24 (2), 317-342, (2012).

M. Wendler (C3): U-processes, U-quantile processes and generalized linear statistics of dependent data, *Stochastic Processes and their Applications* 122, 787-807, (2012).

D. Wied, W. Krämer (beide A1) und H. Dehling (C3, C5): Testing for a change in correlation at an unknown point in time using an extended functional delta method, *Econometric Theory* 28 (3), 570-589, (2012).

D. Wied (A1), R. Weißbach: Consistency of the kernel density estimator - a survey, *Statistical Papers* 53 (1), 1-21, (2012).

D. Ziggel und D. Wied (A1): Trading strategies based on new fluctuation tests, *IFTA-Journal* 2012, 17-20, (2012).

2) Veröffentlichungen in Sammelbänden, Buchbeiträge

(nur bereits erschienene)

W. Krämer (A1, A4): Das Signifikanztest-Ritual und andere Sackgassen des Fortschritts in der Statistik, *AStA Wirtschafts- und Sozialstatistisches Archiv* 5, 299-308, (2012).

W. Krämer (A1, A4): The cult of statistical significance - What economists should and should not do to make their data talk, *Schmollers Jahrbuch* 131, 455-468, (2011).

R. Martin (B3) und D. Kolossa: Voice Activity Detection, Noise Estimation, and Adaptive Filters for Acoustic Signal Enhancement, in: T. Virtanen, R. Singh und B. Raj (eds.): *Techniques for Noise Robustness in Automatic Speech Recognition*, Wiley, Kapitel 4, (2012).

A. Nagathil (B3), P. Göttel und R. Martin (B3): Hierarchical Audio Classification Using Cepstral Modulation Ratio Regressions Based on Legendre Polynomials, *Proceedings of the International Conference on Acoustics, Speech and Signal Processing (ICASSP)*, Prag, Tschechische Republik, 22.-27.05.2011.

A. Nagathil und R. Martin (beide B3): Optimal Signal Reconstruction From a Constant-Q Spectrum, in *Proceedings of the International Conference on Acoustics, Speech and Signal Processing (ICASSP)*, Kyoto, Japan, 25.-30.03.2012.

A. Schlesinger (B3): Transient-based Speech Transmission Index for Predicting Intelligibility in Nonlinear Speech Enhancement Processors, in *Proceedings of the International Conference on Acoustics, Speech and Signal Processing (ICASSP)*, Kyoto, Japan, 25.-30.03.2012.

3) Populärwissenschaftliche Texte:

R. Martin und T. Gerkmann (beide B3) "Besser Hören dank Algorithmen: Wie digitale Signalverarbeitung Hörgeräte verbessert und die Kommunikation erleichtert", RUBIN Wissenschaftsmagazin, Frühjahr 2011, Ruhr-Universität Bochum. (auch in: *Deutsche Zeitschrift für klinische Forschung* 2011-9-10, 38-43.)

A. Rooch (B3): "Musik in den Ohren: Im Sonderforschungsbereich 823 wollen Statistiker Hörgeräte konzerttauglich machen", *mundo Wissenschaftsmagazin*, TU Dortmund 15/2011, 50-55.

4) Radiobeiträge

Teilprojekt B3: "Formeln für die Ohren: Wie Mathematik und Statistik Hörgeräte verbessern", WDR 5 Leonardo, Sendung vom 22.12.2011, 16:05 bis 17:00 Uhr.

5) Software

T. Kley (C1), "quantspec: Quantile-based Spectral Analysis Functions", R package version 0.1

Vorträge

1) Eingeladene Haupt- und Plenarvorträge:

H. Dehling (C3, C5): Nonparametric Change-Point Tests for Long-Range Dependent Data, Conference Prediction of Time Series and Nonstationary Times, Paris, 11.02.2012.

H. Dehling (C3, C5): Nonparametric Change-Point Tests for Long-Range Dependent Data. Long-Range Dependence, Self-Similarity and Heavy Tails, Conference in Honor of Murad S. Taqqu, Research Triangle Park, North Carolina (USA), 20.04.2012.

H. Dette (A1, C1, C2): Geometry, optimal designs and pharmacokinetic models, The 2nd Institute of Mathematical Statistics Asia Pacific Rim Meeting, Tsukuba, Japan, 04.07.2012.

H. Dette (A1, C1, C2): Optimal designs, orthogonal polynomials and random matrices, 44^e Journées de Statistique, Société Française de Statistique, Université Libre de Bruxelles, Belgien, 23.05.2012.

R. Fried (C3), N. Raabe (B4) und A. Thieler: On the robust analysis of periodic nonstationary time series, COMPSTAT 2012, Limassol, Zypern, 27.08.-31.08.2012.

M. Frondel (A3): Kosten und Risiken der Energiewende, Jahrestagung der Deutschen Physikalischen Gesellschaft - Arbeitskreis Energie, Berlin, 26.-28.03.2012.

W. Krämer (A1, A4): Irrational behaviour towards risk, 6th World Skeptics Congress, Berlin, 19.05.2012.

W. Krämer (A1, A4): Hysterie als Standortnachteil, Villa Lessing, Saarbrücken, 24.05.2012 (auch: Neujahrsempfang, Ruhr-Nachrichten, Dortmund, 06.01.2012; Reihe "Zwischen Brötchen und Borussia", TU Dortmund, 21.01.2012, 4. Magdeburger Mathe-Nachts-Traum, Moritzhof Magdeburg, 30.05.2012).

R. Martin (B3): Single and Multi-channel Enhancement of Audio Signals, IEEE Signal Processing Society Winter School on Speech and Audio Processing for Immersive Environments and Future Interfaces, Heraklion, Griechenland, 16.-20.01.2012.

2) Sonstige Vorträge auf Konferenzen:

P. Behl (C1): Focused model selection for nonlinear quantile regression, 10th German Probability and Statistics Days (Stochastiktag), Mainz, 06.-09.03.2012.

M. Borowski (C1), R. Fried (C3): Online signal extraction from data streams by robust moving window regression with automatic width adaption, 4th International Conference of the ERCIM Working Group on Computing & Statistics, London, Großbritannien, 17.-19.12.2011.

C. Bredemeier (A4): A political winner's curse: preventive policies in parliament, Annual Conference of the Scottish Economic Society, Perth, Australien, 17.04.2012.

A. Bücher (A1): Multiplier Bootstrap of Tail Copulas, Oberwolfach Conference "The Mathematics and Statistics of Quantitative Risk Management", 29.01.-04.02.2012.

A. Bücher (A1): Sequential empirical copula processes under serial dependence, 10th German Probability and Statistics Days (Stochastiktag), Mainz, 06.-09.03.2012.

H. Dehling (C3, C5): Empirical Processes of Multidimensional Systems with Multiple Mixing Properties, 10th German Probability and Statistics Days (Stochastiktag), Mainz, 06.-09.03.2012.

H. Dehling (C3, C5): Robust Change-Point Tests for Dependent Data, Conference Statistical Models for Financial Data, Graz, Österreich, 23.-26.05.2012.

J. Franke (A5): Conflict Networks, Annual Meeting of the Royal Economic Society, Cambridge, Großbritannien, 27.03.2012.

J. Franke (A5): Discrimination, Endogenous Entry, and Incentives in Contests, Young Researchers Workshop on Contests and Tournaments, TU Berlin, 02.12.2011.

R. Fried und H. Dehling (beide C3): Robust Shift Detection in Time Series, 10th German Probability and Statistics Days (Stochastiktag), Mainz, 06.-09.03.2012.

R. Fried (C3), N. Raabe (B4) und A. Thieler (C3): Robust analysis of periodic nonstationary time series, Statistische Woche 2012, Wien, Österreich, 17.09.-21.09.2012.

M. Gühlich (C1): Testing for additivity in nonparametric quantile regression, 10th German Probability and Statistics Days (Stochastiktag), Mainz, 06.-09.03.2012.

- T. Hildebrandt (A1, C1): Asymptotic normality for inverse regression models with convolution-type operators and random design, 10th German Probability and Statistics Days (Stochastiktag), Mainz, 06.-09.03.2012.
- F. Jüßen (A4): Exchange Rate Regimes and Fiscal Multipliers, Konferenz "Fiscal Policy in the Aftermath of the Financial Crisis", Brüssel, Belgien, 02.03.2012.
- T. Kley (C1): A Quantile-Based Approach to Spectral Analysis of Time Series, 4th International Conference of the ERCIM Working Group on Computing & Statistics, London, Großbritannien, 17.-19.12.2011.
- T. Kley (C1): Of Copulas, Quantiles, Ranks and Spectra: An L_1 Approach to Spectral Analysis, 10th German Probability and Statistics Days (Stochastiktag), Mainz, 06.-09.03.2012.
- W. Krämer (A1): Testing for a change in the dependence structure of financial asset returns, Workshop "Methods and Challenges in Financial Risk Management", Kloster Drübeck, 30.04.-01.05.2012.
- A. Nagathil und R. Martin (beide B3): Cepstral Modulation Features for Versatile Audio Classification Tasks, Joint Annual Conference of the German Association for Pattern Recognition (DAGM) and the German Classification Society (GfKL), Frankfurt, 30.08.-02.09.2011.
- P. Preuß (C1): A measure of stationarity in locally stationary processes, 10th German Probability and Statistics Days (Stochastiktag), Mainz, 06.-09.03.2012.
- A. Rooch (C3): Bruch oder nicht? Strukturbruchtests in stark abhängigen Daten, Doktorandinnen- und Doktorandentreffen der DMV-Fachgruppe Stochastik, Ruhr-Universität Bochum, 13.-15.10.2011.
- A. Rooch (C3): Nonparametric Change-Point Tests for Long-Range Dependent Data, 10th German Probability and Statistics Days (Stochastiktag), Mainz, 06.-09.03.2012.
- A. Schabert (A4): Fiscal Policy, Sovereign Default, and Bailouts, Ausschuss für Geldpolitik, Verein für Socialpolitik, Ausschusssitzung 2012, Bundesbank, Frankfurt am Main, 17.03.2012.
- A. Schnurr (C5): The Semimartingale Perspective on a Class of Feller Processes with Killing, 10th German Probability and Statistics Days (Stochastiktag), Mainz, 06.-09.03.2012.
- M. Vetter (A1): Estimation of integrated volatility of volatility, 10th German Probability and Statistics Days (Stochastiktag), Mainz, 06.-09.03.2012 (auch: Statistics for Stochastic Processes: Inference, Limit Theorems, Finance and Data Analysis, Paris, Frankreich, 12.-13.03.2012).
- D. Vogel (C3): A nonparametric test for a change-point in correlation, 4th International Conference of the ERCIM Working Group on Computing & Statistics, London, Großbritannien, 17.-19.12.2011.
- D. Vogel (C3): An efficient and robust test for change-points in correlation, Workshop Robust Methods for Dependent Data, Witten, 27.02.2012.

D. Vogel (C3): An efficient and robust test for change-points in correlation, 10th German Probability and Statistics Days (Stochastiktage), Mainz, 06.-09.03.2012.

S. Volgushev (C1): Nonparametric estimates of quantile curves for censored data, 4th International Conference of the ERCIM Working Group on Computing & Statistics, London, Großbritannien, 17.-19.12.2011.

M. Wendler (C3): Good and bad news for the block bootstrap of quantiles, 10th German Probability and Statistics Days (Stochastiktage), Mainz, 06.-09.03.2012.

D. Wied (A1): Testing for structural changes in the dependence structure at an unknown point in time, 4th International Conference of the ERCIM Working Group on Computing & Statistics, London, Großbritannien, 17.-19.12.2011.

D. Wied (A1): Testing for structural changes in the dependence structure at an unknown point in time, Workshop 'Time Series: Models, Breaks and Applications', Karlsruhe, 01.-03.03.2012.

D. Wied (A1): An efficient and robust test for change-point in correlation, Workshop "Methods and Challenges in Financial Risk Management", Kloster Drübeck, 30.04.-01.05.2012.

J.H.C. Woerner (C5): Inference for stochastic volatility models with jumps, CFE-Conference, London, Großbritannien, 17.-19.12.2011.

J.H.C. Woerner (C5): Ornstein-Uhlenbeck based moving average processes, 10th German Probability and Statistics Days (Stochastiktage), Mainz, 06.-09.03.2012.

J.H.C. Woerner (C5): Modelling and inference for modified Lévy driven Ornstein-Uhlenbeck processes, Workshop Statistical Methods for Dynamical Stochastic Models, Paris, 07.-09.06.2012.

3) Vorträge in Fakultätsseminaren:

C. Bredemeier (A4): Minimum wages and female labor supply in Germany, RWI-Forschungsseminar, Essen, 10.05.2012.

H. Dehling (C3, C5): Nonparametric Change-Point Tests for Long-Range Dependent Data, Séminaire de Probabilités et Théorie Ergodique, Tours, 16.03.2012.

H. Dette (A1, C1, C2): Of Copulas, Quantiles, Ranks and Spectra an L1-Approach to Spectral Analysis, Stochastisches Kolloquium, Institut für Mathematische Stochastik, Georg-August-Universität Göttingen, 09.05.2012.

W. Krämer (A1, A4): Hysterie als Standortnachteil, Universitätsklinikum Düsseldorf, 07.03.2012.

W. Krämer (A1, A4): Die Angst der Woche - Warum wir uns vor den falschen Dingen fürchten, Fachhochschule Dortmund, 24.04.2012.

L. Linnemann (A4): Fiscal sustainability and the pricing of government debt, Forschungszentrum der Deutschen Bundesbank, Frankfurt, 24.02.2012.

R. Martin (B3): "Kompakte Repräsentation der Zeit-Frequenzstruktur von Audiosignalen für die Audioklassifikation, RWTH Aachen, Fakultät Elektrotechnik und Informationstechnik, Kolloquium Kommunikationstechnik, 15. Juli 2011.

A. Schnurr (C5): Some Remarks on Feller Semimartingales and their Symbols, Michigan State University, East Lansing, 27.03.2012.

D. Vogel (C3): An efficient and robust test for change-points in correlation, Department of Statistics, University of California, Davis, 9.02.2012.

(auch: Department of Statistics and Biostatistics, Rutgers University, Piscataway, 28.03.2012.

S. Volgushev (C1): Penalisierte Schätzer für den zensierten Quantilsprozess, Philipps-Universität Marburg, 09.02.2012.

4) Poster

H. Dehling (C3, C5), D. Vogel (C3), M. Wendler (C3), D. Wied (A1): An efficient and robust test for change-point in correlation, Workshop on Time Series: Models, Breaks and Applications, KIT Karlsruhe, 01.-03.02.2012.

S. Glaser (C5): A LLN and a CLT for the power variation of fractional Lévy processes, Workshop "Statistical Methods for Dynamical Stochastic Models", Paris, 07.-09.06.2012.

A. Rehage (B1): Outlier detection for contingency tables based on minimal patterns, Workshop "Robust methods for dependent data", Dortmund, 26.-29.02.2012.

M. Wendler (C3): Robust change point detection under dependence, Workshop on Time Series: Models, Breaks and Applications, KIT Karlsruhe, 01.-03.02.2012.

A. Schnurr (C5): Generalized Blumenthal-Gettoor Indices and Some Applications, Workshop Statistical Methods for Dynamical Stochastic Models, Paris, 07.-09.06.2012.

Abschlussarbeiten

B. Berghaus (C1): Schätzen und Testen bei multivariaten Extremwertcopulas, Masterarbeit, Ruhr-Universität Bochum, Fakultät für Mathematik, 09.03.2012.

K. Kettelhake (C2): Multiplikative Algorithmen zur Berechnung optimaler Versuchspläne in IR-Modellen, Masterarbeit, Ruhr-Universität Bochum, Fakultät für Mathematik, 04.08.2011.

E. Nghonse Fiassap (C3): Generalisierte lineare Modelle für Zählraten mit Häufung in der Null, Bachelorarbeit, TU Dortmund, Fakultät Statistik, 21.05.2012.

S. Skowronek (C2): Validierung von Single-Index Modellen, Masterarbeit, Ruhr-Universität Bochum, Fakultät für Mathematik, 20.12.2011.

N. Kukova (A1): Abhängigkeitsmodellierung bei der Quantifizierung operationeller Risiken in Kreditinstituten auf Basis eines Verlustverteilungsansatzes, Diplomarbeit, TU Dortmund, Fakultät Statistik, 05.03.2012.

Promotionen

H. El Saied (C3): Robust Modelling of Count Data: Applications in Medicine, Fakultät Statistik, TU Dortmund, 19.03.2012.

M. van Kampen (A1): Copula constancy tests, Wirtschafts- und Sozialwissenschaftliche Fakultät, TU Dortmund, 02.03.2012.

Sonstiges

H. Dehling (C3, C5) ist Vorsitzender des Scientific Programme Committee der German-Polish Joint Conference on Probability and Mathematical Statistics, Torun, 06.-09.06.2013.

R. Fried (C3) leitet die Sektion "Time Series Modelling and Computation" und gehört zum wissenschaftlichen Programmkomitee beim 20. Symposium on Computational Statistics COMPSTAT 2012, Limassol, Zypern, 27.-31.08.2012.

R. Fried (C3) leitet die Sektion "Computational Statistics" bei der Statistischen Woche 2012, Wien, 18.-21.09.2012.

R. Fried (C3) ist neuer Co-Editor von Statistics: A Journal of Theoretical and Applied Statistics.

S. Kuhnt (B1) ist Mitglied im Programmkomitee der ENBIS 2012, Ljubljana, Slowenien, 09.-13.09.2012.

J. Woerner (C5) organisiert gemeinsam mit L. Slominski die Sektion 'Stochastische Analysis' bei der German-Polish Joint Conference on Probability and Mathematical Statistics, Torun, 06.-09.06.2013.

SFB-Mitglieder unterwegs

T. Kley (C1) besuchte vom 15.-24.11.2011 M. Hallin (C1) an der Princeton University zur Fertigstellung des Projekts "Of copulas, quantiles, Ranks and spectra: An L_1 Approach to spektral Analysis".

A. Schabert (A4) besuchte mehrfach K. Christoffel in der Forschungsabteilung der Europäischen Zentralbank in Frankfurt im Zeitraum Oktober 2011 bis April 2012 zur Zusammenarbeit an dem Projekt "Central Bank Balance Sheet Policies in the Euro-Area".

S. Volgushev (C1) forscht gemeinsam mit R. Koenker an der University of Illinois, Urbana-Champaign, als DFG-Stipendiat vom 01.03.2012 bis 28.02.2013 an dem Projekt "Quantile regression for twice and doubly censored data".

Gastwissenschaftler

Am 13. Dezember 2011 hatte der SFB einen besonderen Gast: Professor Deidre McCloskey der University of Illinois. Deidre McCloskey ist eine der führenden Gestalten in der amerikanischen Ökonomen-Szene und hat zuletzt durch ihr Buch (mit Stephen Ziliak) "The Cult of statistical significance: How the Standard Error Costs Us Jobs, Justice, and Lives" große Wellen geschlagen. Das war zugleich auch Thema ihres Vortrages, den sie ohne alle technische Hilfsmittel in freier Rede vortrug: "What was good enough for Socrates is good enough for me."



C. Becker, (Lehrstuhl für Statistik, Juristische und Wirtschaftswissenschaftliche Fakultät, Martin-Luther Universität Halle-Wittenberg), Forschungsaufenthalt an der Fakultät Statistik, TU Dortmund, 05.06.-06.06.2012.

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

A. Biswas (Applied Statistics Unit, Indian Statistical Institute, Kalkutta): Vortrag "Comparison of treatments and data-dependent allocation for circular data from a cataract surgery", 30.03.2012.

L. Cardoso Jacobs (Juristische und Wirtschaftswissenschaftliche Fakultät, Martin-Luther Universität Halle-Wittenberg): Vortrag "Modellgestützte Bewertung von Verfahren zur Erhebung sensibler Merkmale", 05.06.2012.

S.S. Dhar (Department of Pure Mathematics and Mathematical Statistics, University of Cambridge): Forschungsaufenthalt an der Fakultät Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 27.03.-31.03.2012.

A. Leucht (Institut für Mathematische Stochastik, TU Braunschweig): Vortrag: "Dependent wild bootstrap for Degenerate U- and V-Statistics", 13.01.2012.

W.G. Müller (Institut für Angewandte Statistik, Johannes Kepler Universität Linz): Forschungsaufenthalt an der Fakultät Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 22.02.-24.02.2012.

T.K. Nayak (Department of Statistics, George Washington University, Washington, D.C.): Vortrag "Some general theory of statistical prediction with applications", 22.05.2012.

N. Neumeyer (FB Mathematik, Universität Hamburg): Forschungsaufenthalt an der Fakultät Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 12.12.-14.12.2011.

E. Riccomagno (Dipartimento di Matematica, Università di Genova): Forschungsaufenthalt an der Fakultät Statistik, TU Dortmund, 15.06.-31.07.2012.

R. Schäfer (Wirtschaftsphysik, Universität Duisburg-Essen): Vortrag: "Non-stationarity of financial markets - Identifying and analyzing market states", 17.04.2012.

P. Shpilev (Department of Mathematics, St. Petersburg State University): Forschungsaufenthalt an der Fakultät Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 04.05.-30.05.2012.

M. S. Taqqu (Department of Mathematics and Statistics, Boston University): Vortrag "Long-Range Dependence and the Ranks of Decompositions", Forschungsaufenthalt an der Fakultät Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 01.-05.03.2012.

A. Zhigljavsky (School of Mathematics, Cardiff University): Forschungsaufenthalt an der Fakultät Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 19.03.-21.03.2012.

Workshops, Tagungen

Bereits gewesen:

Robust Methods for Dependent Data, 26.02.-29.02.2012, Lukas-Zentrum, Witten:
Organisation: R. Fried (C3), S. Kuhnt (B1) und Ch. Müller

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



Workshop "Robust Methods for Dependent Data", finanziert vom SFB 823 und der DStatG, mit Teilnehmern aus 8 Ländern

Frontiers in Nonparametric Statistics, 11.03.-16.03.2012, Mathematisches Forschungsinstitut Oberwolfach:
Organisation: H. Dette (A1, C1, C2).

http://www.mfo.de/occasion/1211/www_view

11th Workshop on Quality Improvement Methods, 08.06.-09.06.2012, Dortmund:
Organisation: N. Bauer, C. Weihs (beide C2, B4) und J. Kunert (B2, C2).

http://www.statistik.tu-dortmund.de/workshop_quality_eng.html

Methods and Challenges in Financial Risk Management, gemeinsamer Workshop der SFBs 649 und 823, 29.04.-01.05.2012, Kloster Drübeck, Harz:
Organization: M. Schienle, Ch. Gische und W. Härdle (alle HU Berlin)

<http://lvb.wiwi.hu-berlin.de/jpoe/berlin-dortmund-workshop-2012>

Kommt noch:

Frontiers in Quantile Regression, 25.11.-01.12.2012, Mathematisches Forschungsinstitut Oberwolfach.

Organisation: V. Chernozhukov, H. Dette (A1, C1, C2), X. He, R. Koenker.

http://www.mfo.de/occasion/1248b/www_view

Diskussionspapiere

- 22/12 C. Bredemeier und H. Goecke (beide A4): Sticky information vs. sticky prices: A cross-country study of inflation dynamics.
- 21/12 S. Volgushev (C1), M. Birke (C4), H. Dette (C1) und N. Neumeyer: Significance testing in quantile regression.
- 20/12 H. Dette (C2), W.G. Müller: Optimal designs for regression models with a constant coefficient of variation.
- 19/12 M. Arnold und D. Wied (beide A1): Testing for structural change in spatial regions at unknown positions.
- 18/12 R. Gralla und K. Kraft (beide A5): Higher wages, overstaffing or both? The employer's assessment of problems regarding wage costs and staff level in codetermined establishments.
- 17/12 M. Wendler und O. Sh. Sharipov (beide B3): Noncentral limit theorem and the bootstrap for quantiles of dependent data.
- 16/12 A. Bücher und M. Vetter (beide A1): Nonparametric inference on Lévy measures and copulas.
- 15/12 F. Jüßen, L. Linnemann und A. Schabert (A4): Default risk premia on government bonds in a quantitative macroeconomic model.
- 14/12 M. Frondel und C. Vance (beide A3): Asymmetry: Resurrecting the roots.
- 13/12 P. Behl, G. Claeskens und H. Dette (A1, C1): Focused model selection in quantile regression.
- 12/12 D. Wied (A1) und P. Galeano: Monitoring correlation change in a sequence of random variables.
- 11/12: Ch. Bredemeier (A4): Inattentive voters and welfare-state persistence.
- 10/12: N. Bauer, J. Schiffner und C. Weihs (alle C2): Einfluss der Musikinstrumente auf die Güte der Einsatzzeiterkennung.
- 09/12: G.N.F. Weiß (A4) und H. Supper: Liquidity commonality and risk management.
- 08/12: F. Jüßen und L. Linnemann (beide A4): Government spending and unemployment in the OECD: Evidence from an annual panel VAR.
- 07/12: J. Wagener, S. Volgushev und H. Dette (beide A1, C1): The quantile process under random censoring.

- 06/12: A. Rehage, N. Rudak, B. Hussong, S. Kuhnt und W. Tillmann (alle B1): Prediction of in-flight particle properties in thermal spraying with additive day-effects.
- 05/12: H. Dette u. Ch. Kiss (beide C2): Optimal designs for rational regression models.
- 04/12: H. Dette und J. Kunert (beide C2): Optimal designs for the Michaelis Menten model with correlated observations.
- 03/12: H. Dehling (C3, C5), O. Durieu, M. Tusche: Empirical processes of Markov chains and dynamical systems indexed by classes of functions.
- 02/12: R. Iovanna und C. Vance (A3): Land conversion and market equilibrium: Insights from a simulated landscape.
- 01/12: M. Frondel und C. Vance (beide A3): On interaction effects: The case of Heckit and two-part models.
- 52/11 H. Dette (A1, C1), M. Gühlich und N. Neumeyer: Testing for additivity in nonparametric quantile regression.

Alle Diskussionspapiere zum Herunterladen unter:

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