

Dissertationen

Philipps - Universität Marburg

- Gleichmäßige Asymptotik für Wahrscheinlichkeiten großer Abweichungen mit Anwendungen auf Erdős - Rényi - Zuwächse (E. Dersch, 1990)
- Invarianzprinzipien in verallgemeinerten Risikomodellen (M. Alex, 1994)
- Zur Changepoint - Analyse von Erneuerungsprozessen (K.-F. Landau, 1998)
- Changepoint - Analyse für Kenngrößen der Telekommunikation: Theorie und Simulationen (J. Giese, 2003)
- Hilbert'sche Zerlegungen eingebetteter Prozessräume und ihre Anwendung auf die Vorhersage von Zeitreihen (R. Jäger, 2004)

Universität zu Köln

- Sequential Change - Point Analysis Based on Invariance Principles (A. Aue, 2004)
- Resampling Methods for the Change Analysis of Dependent Data (C. Kirch, 2006)
- Sequential Change - Point Analysis Based on Weighted Moving Averages (M. Kühn, 2008)
- Sequential Change - Point Detection for Diffusion Processes (S. Mihalache, 2011)
- Limit Theorems in Change-Point Analysis for Dependent Data (A. Schmitz, 2011)
- Arbeitstitel: "Asymptotische statistische Verfahren zur Aufdeckung von Strukturbrüchen" (S. Fremdt, in Vorbereitung)
- Arbeitstitel: "Monitoring-Verfahren für statistische Zeitreihen" (H. Timmermann, in Vorbereitung)
- Arbeitstitel: "Statistische Strukturanalyse hochdimensionaler Daten" (L. Torgovitski, in Vorbereitung)

Diplomarbeiten

Philipps - Universität Marburg, WS 1980/81 - SS 1987

- Gesetze vom Erdős - Rényi - Typ bei Erneuerungsprozessen (M. Retka, 1982)
- Schwache Konvergenzaussagen für Erdős - Rényi - Maxima (J. Landau, 1983)
- Erdős - Rényi - Gesetze unter Abhängigkeiten (J. Gallien, 1984)
- Starke Approximationen bei Erstaustrittszeiten (V.R. Huse, 1984)
- Bedingte Grenzwertsätze bei Wahrscheinlichkeiten großer Abweichungen (E. Dersch, 1984)
- Momenterzeugende Funktionen und Chernoff - Funktionen (K.-H. Schmidt, 1984)
- Starke Approximationen in der Erneuerungstheorie (W. Michel, 1986)
- Invarianzprinzipien für zusammengesetzte Erneuerungsprozesse (R. Gießing, 1988)
- Extremwertverteilungen bei Erneuerungsprozessen (M. Quinque, 1988)
- Verbesserte Gesetze vom Erdős - Rényi - Typ für Zufallsfelder (W. Pfuhl, 1988)
- Zur Konvergenzgeschwindigkeit im Gesetz der großen Zahlen für erweiterte Erneuerungsprozesse (H. Luckhardt, 1988)
- Invarianzprinzipien in der Warteschlangentheorie (M. Alex, 1988)

Universität Hannover, WS 1987/88 - WS 1990/91

Diffusionsapproximationen für Ruinwahrscheinlichkeiten (K. Knauf, 1991)

Philipps - Universität Marburg, SS 1991 - SS 2002

Zur Asymptotik von Pontogrammen (K.F. Landau, 1993)

Schätzung des Anpassungskoeffizienten in verallgemeinerten Risikomodellen (R. Christ, 1994)

Eine Klasse von Schätzern für den Anpassungskoeffizienten in der Risikothorie (J. Schultze, 1994)

Qualitätsvergleich von Anpassungstests zur Auswertung experimenteller Daten (K. Maass, 1994)

Prognose von Überbuchungswahrscheinlichkeiten im Flugverkehr auf der Basis einer Buchungsdatenbank (O. Werner, 1995)

Schätzung von Anpassungskoeffizienten in Risikomodellen mit Diffusionskomponenten (A. Müller, 1996)

Konstruktion simultaner Konfidenzbänder für ROC - Kurven (H.-C. Nürk, 1996)

Zur Schätzung von Pareto - Indizes mit Anwendungen in der Risikothorie (R. Stein, 1996)

Starke Approximationen von Erneuerungsprozessen im nicht identisch verteilten Fall (J. Giese, 1996)

Zur Rolle des klinischen Effekts in Gruppensequentialplänen (H. Haverkamp, 1996)

Zur Asymptotik von Erstaustrittszeiten und deren Anwendungen in der Risikothorie (U. Putschke, 1996)

Finanzmathematische Aspekte bei der Prämienkalkulation unter ökonomischen Einflussgrößen (J. Steinbrecher, 1996)

Fast sichere Konvergenzsätze über die Oszillationen spezieller stochastischer Prozesse (G. Gieseke, 1997)

Zur Abschätzung von Ruinwahrscheinlichkeiten in Markov - modulierten Risikoprozessen (M. Schmidt, 1997)

Extremwertstatistik und Prämienkalkulation bei der Rückversicherung von KV - Tarifen (C. Näcker, 1999)

Risikokalkulation für ein Portfolio mit Optionen (S. Klee, 1999)

Statistische Analyse von " Changeparametern" auf der Basis von Invarianzprinzipien (C. Kühn, 1999)

Grenzwertsätze für das Testen des Auftretens gradueller Veränderungen (R. Beier, 1999)

Changepoint - Methoden für die Segmentierung von DNS - Sequenzen (A. Victor, 1999)

Zur Schätzung von Varianzen in der Changepoint - Analyse (M. Riedle, 2000)

Zur Rolle der Esscher - Transformierten in der Finanzmathematik (B. Schlitt, 2000)

Zur mathematischen Modellierung und Analyse von Zinsrisiken (T. Graf, 2000)

Zur Schätzung von graduellen Veränderungen auf der Basis von Invarianzprinzipien (A. Aue, 2000)

Modellierung und Bewertung von Finanzinstrumenten unter Berücksichtigung des Kreditrisikos (M. Trouvain, 2000)

Die Automatisierung der Parameterwahl beim Datamining am Beispiel radialer Basisfunktionen (K. Stinsmeier, 2001)

Stochastische Integration bzgl. fraktaler Brownscher Bewegungen und deren Anwendung in der Finanzmathematik (N. Wallner, 2001)

Sequentielle Changepoint - Analyse auf der Basis von Invarianzprinzipien (S. Hanf, 2002)

Permutationsprinzipien in der Changepoint - Analyse (C. Kirch, 2003)

Universität zu Köln, seit WS 2002/03

Zur Strukturanalyse von bedingt heteroskedastischen Zeitreihen (N. Kulenko, 2005)

Changepoint - Analyse unter diskreten Verteilungen (S. Schürmann, 2005)

Strukturanalyse von RCA(p) - Zeitreihen (T. Ucsnay, 2006)

On the Statistical Analysis of Augmented GARCH Sequences (D. Reinhold, 2006)

Strukturanalyse linearer Modelle: Asymptotische Normalität von Stoppzeiten (M. Kvesic, 2006)

Statistische Analyse von Strukturbrüchen in der Volatilität stochastischer Prozesse (J. Liebehenschel, 2006)

Sequentielle Analyse von epidemischen Strukturbrüchen bei unbekanntem Modellparametern (S. Gawel, 2006)

Sequentielles Testen von Ruinwahrscheinlichkeiten im Sparre Andersen'schen Risiko-modell (D. Jahnke, 2007)

Monitoring Changes in Dependent Data (A. Schmitz, 2007)

Exakte und approximative Algorithmen zur Berechnung der Zonoid- und der Halbraumtiefe (N. Kasemir, 2007)

Sequentielles Testen von Ruinwahrscheinlichkeiten in Risikomodellen mit Diffusionskomponenten (A. Lenzen-Heinz, 2009)

Sequentielles Testen von Strukturbrüchen in linearen Modellen auf der Basis von Invarianzprinzipien (I. Ostler, 2010)

Monitoring-Verfahren für stochastische Prozesse mit graduellen Strukturbrüchen (H. Timmermann, 2010)

Zur Asymptotik von Stoppzeiten bei Monitoring-Verfahren für epidemische Strukturbrüche (S. Seven, 2010)

Berechnung von Zonoid-Trimmbereichen einer multivariaten Verteilung mit exakten und approximativen Methoden (I. Schwab, 2011)

Sequentielles Testen von Strukturbrüchen in der Varianz von Erneuerungsprozessen (G. Sleptsov, 2011)

Bachelorarbeiten

Universität zu Köln, seit SS 2010

Das starke Gesetz der großen Zahlen für paarweise unabhängige Zufallsvariablen (Y. Hoga, 2010)

Die Black-Scholes-Formel anhand von Binomialbäumen (A. Kupicha, 2010)

Der Poisson-Prozess: Theoretische Grundlagen und Anwendungen in der Risikotheorie (J. Kurtz, 2011)

Modellbasiertes Handtracking mit dem Unscented Kalman-Filter (C. Peter, 2011)

Das Gesetz vom iterierten Logarithmus (L. Schmitz, 2011)