

Dissertationen

Universität zu Köln, WS 2002/03-SS 2016

- Hilbert Space Valued Signal Plus Noise Models: Analysis of Structural Breaks under High Dimensionality and Temporal Dependence (L. Torgovitski, 2016)
- Asymptotic Procedures for a Change-Point Analysis of Random Fields (B. Bucchia, 2016)
- Asymptotic Change-Point Analysis of the Dependencies in Time Series (C. Heuser, 2016)
- Monitoring Procedures for Detecting Gradual Changes (H. Timmermann, 2014)
- Asymptotic Methods in Change-Point Analysis (S. Fremdt, 2012)
- Limit Theorems in Change-Point Analysis for Dependent Data (A. Schmitz, 2011)
- Sequential Change-Point Detection for Diffusion Processes (S. Mihalache, 2011)
- Sequential Change-Point Analysis Based on Weighted Moving Averages (M. Kühn, 2008)
- Resampling Methods for the Change Analysis of Dependent Data (C. Kirch, 2006)
- Sequential Change-Point Analysis Based on Invariance Principles (A. Aue, 2004)

Philipps-Universität Marburg, WS 1980/81-SS 1987, SS 1991-SS 2002

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

Masterarbeiten

Universität zu Köln, SS 2012-WS 2015/16

- Change-point-Verfahren in Capital-Asset-Pricing-Modellen (E.M. Lehmacher, 2015)
- Strukturbruchverfahren für Finanzzeitreihen (J.M. Orthey, 2015)
- Sequentielles Testen von Strukturbrüchen in der Volatilität des Capital Asset Pricing Model (M. Heinen, 2014)
- Testprozeduren zum Aufdecken von Strukturbrüchen in den Korrelationen von Zeitreihen (C. Heuser, 2013)
- Statistische Analyse epidemischer Strukturbrüche in Zufallsfeldern auf der Basis eines schwachen Invarianzprinzips (B. Bucchia, 2012)
- Strukturbruchtests für den Flankenindex bei abhängigen Daten (Y. Hoga, 2012)

Bachelorarbeiten

Universität zu Köln, SS 2010- SS 2015

- Diffusionsapproximationen in der Risikothorie (I. Rotmann, 2015)
- Der Wiener-Prozess: Konstruktion, Eigenschaften, Anwendungen (L. Brinker, 2014)
- Finanzmarktmodelle mit Sprüngen (S. Borschbach, 2014)
- Zur Abschätzung von Ruinwahrscheinlichkeiten in der Risikothorie (N. Hilverkus, 2014)
- Die Erneuerungsgleichung – Theorie und Anwendungen in der Risikothorie (B. Aymans, 2014)
- Starke und schwache Gesetze der großen Zahlen (L. Lühtrath, 2014)
- Die Black-Scholes-Formel auf der Basis der geometrischen Brown'schen Bewegung (D. Förster, 2014)
- Zinsratenmodelle (S. Moskopp, 2014)
- Schätzverfahren in der Changepoint-Analyse (A. Moskopp, 2014)
- Bewertung von Barrier-Optionen auf der Basis von Binomialmodellen (D. Hanke, 2014)
- Zur Berücksichtigung von Dividendenzahlungen im diskreten Finanzmarktmodell (S. Lewin, 2014)
- Zur Bewertung amerikanischer Optionen in diskreten Finanzmarktmodellen (J.M. Orthey, 2013)
- No free lunch - Arbitragefreiheit in zeitdiskreten Kapitalmarktmodellen (E. Lehmacher, 2013)
- Das Gesetz vom iterierten Logarithmus (L. Schmitz, 2011)
- Modellbasiertes Handtracking mit dem Unscented Kalman-Filter (C. Peter, 2011)
- Der Poisson-Prozess: Theoretische Grundlagen und Anwendungen in der Risikothorie (J. Kurtz, 2011)
- Die Black-Scholes-Formel anhand von Binomialbäumen (A. Kupicha, 2010)
- Das starke Gesetz der großen Zahlen für paarweise unabhängige Zufallsvariablen (Y. Hoga, 2010)

Diplomarbeiten

Universität zu Köln, WS 2002/03- SS 2014

- Unit-Root-Tests für Finanzzeitreihen (G. Schauff, 2014)
- Sequentielle Changepoint-Analyse auf der Basis von Kernschätzern (O. Grasmik, 2014)
- Zur Asymptotik von Stoppzeiten beim Monitoring des Capital-Asset-Pricing-Modells (M. Osada, 2014)
- Sequentielles Testen von Strukturbrüchen im Trend von multivariaten Erneuerungsprozessen (J. Paschetag, 2013)
- Sequential Testing of a Multivariate Capital Asset Pricing Model (J.B. Janka, 2013)
- Präzise Asymptotiken für Erneuerungszählprozesse (F. Sun, 2012)
- Sequentielles Testen von Strukturbrüchen in der Varianz von Erneuerungsprozessen (G. Sleptsov, 2011)
- Berechnung von Zonoid-Trimmbereichen einer multivariaten Verteilung mit exakten und approximativen Methoden (I. Schwab, 2011)
- Zur Asymptotik von Stoppzeiten bei Monitoring-Verfahren für epidemische Strukturbrüche (S. Seven, 2010)
- Monitoring-Verfahren für stochastische Prozesse mit graduellen Strukturbrüchen (H. Timmermann, 2010)

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Philipps-Universität Marburg, SS 1991 - SS 2002

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

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

Fractional Brownian Motion and Applications to Finance (N. Wallner, 2001)

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Diffusionsapproximationen für Ruinwahrscheinlichkeiten (K. Knauf, 1991)

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

Invarianzprinzipien in der Warteschlangentheorie (M. Alex, 1988)

Zur Konvergenzgeschwindigkeit im Gesetz der großen Zahlen für erweiterte Erneuerungsprozesse (H. Luckhardt, 1988)

Verbesserte Gesetze vom Erdős-Rényi-Typ für Zufallfelder (W. Pfuhl, 1988)

Extremwertverteilungen bei Erneuerungsprozessen (M. Quinque, 1988)

Invarianzprinzipien für zusammengesetzte Erneuerungsprozesse (R. Gießing, 1988)

Starke Approximationen in der Erneuerungstheorie (W. Michel, 1986)

Momentenerzeugende Funktionen und Chernoff-Funktionen (K.-H. Schmidt, 1984)

Bedingte Grenzwertsätze bei Wahrscheinlichkeiten großer Abweichungen (E. Dersch, 1984)

Starke Approximationen bei Erstaustrittszeiten (V.R. Huse, 1984)

Erdős-Rényi-Gesetze unter Abhängigkeiten (J. Gallien, 1984)

Schwache Konvergenzaussagen für Erdős-Rényi-Maxima (J. Landau, 1983)

Gesetze vom Erdős-Rényi-Typ bei Erneuerungsprozessen (M. Retka, 1982)