

Mathematisches Institut
UNIVERSITÄT ZU KÖLN
Prof. Dr. Josef G. Steinebach

50 931 Köln, den 17.11.2011
Weyertal 86-90
Tel. : 0221-470 2891 (Sekr. 2892)
Fax : 0221-470 6073
E-mail: jost@math.uni-koeln.de

Statistik nichtlinearer stochastischer Prozesse

Seminar, WS 2011/12

Literatur

Aue, A., Berkes, I., and Horváth, L. (2006) Strong approximation for the sums of squares of augmented GARCH sequences. *Bernoulli*, **12**, 583 - 608.

Horváth, L., Kokoszka, P., and Zhang, A. (2006) Monitoring constancy of variance in conditionally heteroskedastic time series. *Econometric Theory*, **22**, 373 - 402.

Vorträge

1. Matthias **Vierkötter**: *Monitoring constancy of variance in conditionally heteroskedastic time series.* [Horváth - Kokoszka - Zhang]
2. Yannick **Hoga**: *Strong approximation for the sums of squares of augmented GARCH sequences.* [Aue - Berkes - Horváth]

Zeit und Ort: **Mo, 12.00 - 13.30 Uhr**, Seminarraum 1 des Mathematischen Instituts

Beginn: **17. Oktober 2011**