

BREV
Ukonvoluteret



MEDDELELSER

Dansk Selskab for Teoretisk Statistik

Formiddagsmøde og Todagesmøde i DSTS

3.- 4. November, Syddansk Universitet side 3

Seminarer

Seminar in applied mathematics and statistics, H.C. Ørsted institute, KU side 4

Stillingsopslag

Principal Biostatistician and Biostatistician, LEO Pharma 5
Adjunkt i biostatistik – Det Sundhedsvidenskabelige Fakultet, Syddansk Universitet side 6

Nyt om Navne side 7

Returneres ved varig adresseændring

Næste nummer af "MEDDELELSER" udkommer 2. november 2009.
Bidrag skal være redaktøren i hænde senest **den 23. oktober. 12.00.**

Dansk Selskab for Teoretisk Statistik Bestyrelse 2008	
Formand	fmd@dsts.dk
Niels Richard Hansen Afd. for Anvendt Matematik og Statistik Københavns Universitet Tlf. 35 32 07 83	
Næstformand	nfmd@dsts.dk
Esben Agerbo National Centre for Register-based Research Faculty of Social Sciences University of Aarhus Tlf. 89 42 68 15	
Kasserer	kass@dsts.dk
Malene Højbjerg Novo Nordisk A/S Tlf. 30 79 62 09	
Sekretær	sekr@dsts.dk
Marc Andersen StatGroup ApS Tlf. 61 77 72 48	
Webmaster	web@dsts.dk
Klaus Kaas Andersen Informatics and Mathematical Modelling, Section for Statistics, DTU Tlf.: 45 25 34 19	
Redaktør	red@dsts.dk
Charlotte Hindsberger Novo Nordisk Tlf. 30 79 65 92	

Meddelelser er medlemsblad for Dansk Selskab for Teoretisk Statistik (DSTS), se <http://www.dsts.dk>.

Selskabets formål er at fremme den statistiske videnskab og dens anvendelser.

Indmeldelse og adresseændring i DSTS gøres via <http://www.dsts.dk/da/index.html>.

Selskabet har en elektronisk nyhedsliste E-Meddelelser, se <http://www.dsts.dk/da/index.htm>.

Bidrag og stillingsopslag til Meddelelser sendes til redaktøren - red@dsts.dk. Bidrag i elektronisk form modtages i PDF format med indlejrede fonte i sidestørrelse A4, egnet til sort/hvid tryk i A5 format. Alternativt modtages Word.

Annoncering af stillingsopslag i Meddelelser koster kr. 1.000,- pr. side. Opgiv venligst faktureringsoplysninger. Indstik til udsendelse i konvolut sammen med Meddelelser koster kr. 3.000,- pr. standard A4 side for første side og 500,- kr per efterfølgende side.

Meddelelser udkommer 9 gange om året, den første mandag eller tirsdag i måneden undtagen januar, juli og august måned.

Udgivelsesplan for Meddelelser 2009

Nr.	Bidrag senest	Udkommer
1	23. januar	2. februar
2	20. februar	2. marts
3	27. marts	6. april
4	24. april	4. maj
5	22. maj	1. juni
6	21. august	1. september
7	25. september	5. oktober
8	23. oktober	2. november
9	20. november	1. december

Punktproces formiddagsmøde Formøde til todagesmødet 3. november 2009 klokken 9.00

Vi holder som flere gange tidligere i forbindelse med todagesmødet et formøde om punktprocesser. Mødet er en del af aktiviteterne i netværket der er baseret på forskningsrådets bevilling til projektet *Point process modelling and statistical inference*. Det er et åbent møde, men af hensyn til organiseringen beder vi om at alle interesserede tilmelder sig.

Program:

9.00- 9.30	Thomas Scheike. <i>Estimating haplotype effects for survival data</i>
9.30-10.00	Per Kragh Andersen. <i>Competing risks and time-dependent covariates</i>
10.00-10.15	Pause
10.15-10.45	Thomas Mikosch. <i>Point process modeling of claims reserves</i>
10.45-11.15	NN
11.15-11.30	Pause
11.30-12.00	Niels Richard Hansen. <i>Non-parametric estimation of linear filter functions</i>
12.00-14.00	Frokost

Programmet med abstracts findes på <http://www.math.ku.dk/~richard/pointprocess/>

Sted: Lokale 402, Winsløwsparken 19, Syddansk Universitet, Odense.

Tilmelding: Niels Richard Hansen, Niels.R.Hansen@math.ku.dk, senest den 25. oktober 2009.

Husk også Todagesmødet 3.-4. november 2009

Programmet for mødet og detaljer ang. tilmelding findes her

<http://www.biostat.sdu.dk/Todagesmoede/program.html>

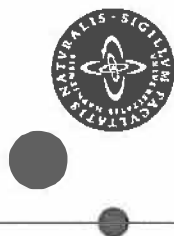
Tilmeldingsfrist den 23. oktober 2009.

DSTS har erfaret at bl. a. Københavns Universitet nu kræver en elektronisk faktura for at kunne overføre deltagerbetalingen til DSTSs konto. DSTS kan ikke stå for at udarbejde elektroniske faktura i forbindelse med betaling for todagesmøder, men alle offentlige institutioner kan selv udarbejde den nødvendige faktura via

https://www.virk.dk/myndigheder/ITST/NemHandel_Fakturablanket

Klik på *Start indberetning* og udfyld med institutionens eget EAN-nummer og udfylders egen emailadresse. Udfyld fakturaen med de nødvendige oplysninger. DSTS skal stå som *leverandør* med følgende oplysninger:

CVR	18004232
Navn	Dansk Selskab for Teoretisk Statistik
Vej og nr.	Universitetsparken 5
Postnummer og by	2100 København Ø
Tlf.	35320783



SEMINAR IN APPLIED MATHEMATICS AND STATISTICS

Wednesday, October 7, 2009, 16:15, aud. 10, H.C. Ørsted Institute

Speakers: Michael Hanke and Alex Weissensteiner, University of Innsbruck

Title: Life-cycle asset allocation and consumption using stochastic linear programming

Abstract: We consider optimal consumption and (strategic) asset allocation of an investor with uncertain lifetime. The problem is solved using a multi-stage stochastic linear programming (SLP) model to be able to generalize the closed-form solution obtained by Richard (1975). We account for aspects of the application of the SLP approach which arise in the context of life-cycle asset allocation, but are also relevant for other problems of similar structure. The objective is to maximize the expected utility of consumption over the lifetime and of bequest at the time of death of the investor. Since we maximize utility (rather than other objectives which can be implemented more easily) we provide a new approach to optimize the breakpoints required for the linearization of the utility function. The uncertainty of the problem is described by discrete scenario trees. The model solves for the rebalancing decisions in the first few years of the investor's lifetime, accounting for anticipated cash flows in the near future, and applies Richard's closed-form solution for the long, subsequent steady-state period. In our numerical examples we first show that available closed-form solutions can be accurately replicated with the SLP-based approach. Second, we add elements to the problem specification which are usually beyond the scope of closed-form solutions, e.g. return predictability. We find that the SLP approach is well suited to account for these extensions of the classical Merton setting.

Friday, October 30, 2009, 14:15, aud. 10, H.C. Ørsted Institute

Speakers: Søren F. Jarner and Michael Preisel, ATP

Title: TBA

SEPTEMBER 25, 2009

UNIVERSITETSPARKEN 5
DK-2100 COPENHAGEN
DENMARK

<http://www.math.ku.dk/>



Pssst... har du hørt, at det går rigtig godt hos LEO Pharma i Ballerup?

Vi er i vækst og har brug for nye medarbejdere:

- Principal Biostatistician
Vi søger en statistiker med erfaring indenfor lægemiddeludvikling og/eller medicinsk forskning. Primære opgaver vil være deltagelse i LEO Pharmas udviklingsprojekter.
- Biostatistician
Vi søger en statistiker, der har interesse for medicinske/biologiske data og analyse og afrapportering af disse.

Klik ind og læs mere på
www.leo-pharma.com



research based, people driven

Adjunkt i biostatistik

En stilling som adjunkt i biostatistik ved Institut for Sundhedstjenesteforskning, Forskningsenheden for Biostatistik, Det Sundhedsvidenskabelige Fakultet, Syddansk Universitet, er ledig til besættelse snarest muligt.

Det Sundhedsvidenskabelige Fakultet er ét af fem fakulteter ved Syddansk Universitet. Fakultetet består af følgende institutter: Institut for Medicinsk Biologi, Institut for Sundhedstjenesteforskning, Klinisk Institut, Institut for Idræt og Biomekanik, og Institut for Regional Sundhedsforskning. Fakultetets uddannelser omfatter medicin, idræt og biomekanik, den sundhedsfaglige kandidat- og suppleringsuddannelse, folkesundhedsvidenskab samt kandidatuddannelsen i biomedicin sammen med Det Naturvidenskabelige Fakultet.

Ansættelse som adjunkt forudsætter videnskabelige og undervisningsmæssige kvalifikationer svarende til en ph.d.-grad erhvervet indenfor biostatistik, statistik eller matematik.

Uddannelsesopgaver

Den, der ansættes, skal kunne indgå i et team der varetager undervisningen i biostatistisk teori og metoder indenfor sundhedsvidenskab ved fakultetets uddannelser.

Forskningsopgaver

Med hensyn til forskningsopgaver lægges der vægt på, at der sker en udvikling inden for forskningsenhedens forskningsprofil (se link nedenfor). Den, der ansættes, skal have en solid biostatistisk baggrund. Der vil ved ansættelsen blive lagt vægt på erfaring med forskning indenfor enhedens forskningsprofil, samt at ansøgeren kan omsætte forskning i sundhedsvidenskabelige anvendelser.

Kvalifikationer

Den, der ansættes, forventes at have kvalifikationer, som svarer til et niveau opnået gennem gennemførelsen af et ph.d.-forløb.

Ansøgere skal dokumentere uddannelsesmæssige erfaringer og kompetencer i forhold til gennemførelse af undervisningsforløb samt vejledning af andre forskere og forskningsaspiranter. Ansøgeren forventes at medvirke med faglig udvikling af undervisningen samt indgåelse i enhedens vejledningstjeneste.

Ansøgerne forudsættes at have dokumenteret videnskabelig produktion på internationalt niveau.

Yderligere oplysninger kan fås ved henvendelse til professor Torben Martinussen, e-mail: tmartinussen@health.sdu.dk, lektor og forskningsleder Jacob Hjelmberg, e-mail: jhjelmberg@health.sdu.dk. Se hele opslaget på http://www.jobs.sdu.dk/vis_stilling.php?id=5416&lang=da

Nyt om navne

Ansættelser på DTU Informatik

- Gilles Guillot er blevet ansat som lektor pr. 1. august.
- Per Bruun Brockhoff er blevet ansat i et permanent professorat pr. 1. september 1/9 2009 efter 5 år som professor "MSO" ("Professor Med Særlige Opgaver").

Kalender 2009 - 2010

Dato	N o.	Aktivitet
7 Oct	7	SEMINAR IN APPLIED MATHEMATICS AND STATISTICS, H.C. Ørsted Institute. <i>Life-cycle asset allocation and consumption using stochastic linear programming</i>
30 Oct	7	SEMINAR IN APPLIED MATHEMATICS AND STATISTICS, H.C. Ørsted Institute. <i>Title: TBA</i>
Oct-Nov 09	Emed	BGC-Network course OSLO: <i>SURVIVAL AND EVENT HISTORY ANALYSIS</i>
3 Nov 09	7	Punktproces formiddagsmøde, Formøde til todagesmødet
3-4. Nov 09	6	Todagesmøde i DSTS, Syddansk Universitet
24-28 Jan 10	6	Workshop, Thiele Centre, University of Aarhus. <i>Workshop on Ambit Processes, Non-Semimartingales and Applications</i>