

M E D D E L E L S E R

f r a

DANSK SELSKAB FOR TEORETISK STATISTIK

Nærmere oplysninger fås ved henvendelse til:

Kari Wangen
Statistisk Sentralbyrå
Postboks 8131 Dep
Oslo 1 - Norge

Telefon: 00947/2413820/598

Deltagergebyr: Nkr. 400,00.

Efterårets møder

Til efteråret planlægges en del aktiviteter omkring hvordan matematisk statistik kan anvendes i andre videnskabsområder. De påtænkte foredrag skulle i princippet blive af samme type som f.eks. F.B. Christiansens for nylig diskuterede foredrag om genetisk fitness.

Endvidere planlægges et to-dages møde i København den 9.-10. november med hovedtema: Køteori. Såvel nyere teori, som helt aktuelle praktiske anvendelser vil blive præsenterede.

Større eller mindre nyheder bedes sendt til:

Meddelelser fra DSTS
v/Jan Holst
IMSOR, Bygning 349
DTH - 2800 Lyngby

Ansvarshavende: Jan Holst, IMSOR.

7. ARG. NR. 5

JUNI 1982

MØDE I SELSKABET

THE SEARCH FOR STRUCTURE IN TIME SERIES:
PROGRESS WITH MULTIVARIATE,
NON-LINEAR AND TIME-VARYING MODELS

G. TUNNICLIFFE-WILSON

Lancaster University, England

TIRSDAG DEN 22. JUNI KL. 19.30 I AUDITORIUM X
PÅ H.C. ØRSTED INSTITUTTET

Resumé:

After the success of empirical ARMA modelling, interest has returned to the interpretation of model properties in terms of structure. Decomposition of the series into independent components in one approach. Dynamic linear models are similar in principle though differ in the use of Kalman filtering. Scope for a structural interpretation is greater in the multivariate context where progress has been made in order identification. Spectral methods have proved useful in detecting and describing the interdependence of two or more series. Evidence has also been found to support the use of fractional differencing in linear models.

Recursive methods of estimation have also helped to detect non-linear and time-varying structure and ad hoc methods of incorporating non-linear terms have been useful in prediction.

Mødets anden og afsluttende del afholdes i KUIMS bibliotek hvor der vil blive serveret øl og madder.

Dr. Granville Tunnicliffe-Wilson giver også et kursus i tid-serieanalyse á la Box-Jenkins ved hjælp af GENSTAT. Kursus afholdes ved RECKU i perioden 21.-24. juni 1982.

Kursusgebyr: 500,00

Kontaktperson: David Edwards - Telefon: (01) 83 95 11

MØDEREFERAT

Ved det seneste møde i selskabet den 18. maj gav Freddy B. Christiansen fra Institut for Genetik og Økologi, Aarhus Universitet, med udgangspunkt i fitnessbegrebet en oversigt over populationsgenetikken fra Darwin og Meldel via genetikerne Fisher til vore dage. Man kunne følge to linier svarende til en mere detaljeret genetisk modeltype funderet på Mendels love og en anden mere fænomenologisk beskrivende modeltype. Efter foredraget udspandt sig en liflig diskussion, som fortsatte ved øl og madder.

AFHANDLINGER

Den 6. maj forsvarede Steffen Lauritzen sin doktorafhandling "Statistical Models as Extremal Families", for det naturvidenskabelige fakultet.

De officielle opponenter var professor Ole Barndorff-Nielsen og lektor Søren Johansen.

Afhandlingen kan erhverves på Aalborg Universitetsforlag

Postbox 159, 9100 Ålborg

Pris: 72,00 kr.

telefon: (08) 15 50 31

Den 28. maj holdt Ib M. Skovgaard sin licentiat forelæsning med titlen:

"Edgeworthudviklinger for summer af flerdimensionale variable".

KALENDARIUM

Licentiat forelæsning:

Københavns Universitet - Det Naturvidenskabelige Fakultet

Cand.Stat. Per Kragh Andersen:

"Partielle Likelihoodfunktioner og
Asymptotisk Teori for Cox-Modellen"

Forelæsningen finder sted onsdag den 23. juni kl. 14.15 i auditorium X på H.C. Ørsted Instituttet, Universitetsparken 5.

Aktuelle gæster

Matilde Macagno Division of Mathematical Sciences University of Iowa	Aarhus	en uge til sommer
Louis F. Pau George Washington University Washington	IMSOR	en måned fra 23. aug.
Henry Daniels Statistical Laboratory University of Cambridge	Aarhus	planlagt til begyndelsen af november

Kongresser

Det 16. Nordiske Statistiker møde finder sted i Oslo i tidsrummet 12.-14. august 1982. Mødets tema er:

"80-årenes krav til statistikken og statistikerne".