

Kalender 2002

(arrangementer annonceret i MEDDELELSER)

Dato	Med. nr.	Aktivitet
6/2	1/02	KU Seminar: Charlotte Strunk Hansen. "The Telescoping Overlap Problem in Options Data."
26/2	1/02	Generalforsamling i DSTS med efterfølgende foredrag ved Peter Dalgaard.
28/2		Thomas Scheike forsvare sin doktorafhandling med titlen: "Dynamic Event History Models". Forsvaret foregår kl. 14:00 i Auditorium 6 på H.C. Ørsted Institutttet, Københavns Universitet. De officielle opponenter er Ludwig Fahrmeir (Muenchen) og Michael Sørensen.
	1/02	SAS foredrag med efterfølgende middag.
9-13/6	7/01	NORDSTAT 2002 - the 19th Nordic Conference on Mathematical Statistics in Stockholm.
23-24/9		Conference: Second Annual ENBIS Conference

Deadlines i år 2002

Frister for indlevering af bidrag:

22. februar kl. 12.
22. marts
22. april
24. maj

MEDDELELSER udkommer

1. marts
2. april
1. maj
1. juni

Næste nummer af "MEDDELELSER" udkommer 1. marts 2002.

Bidrag til dette nummer skal være redaktøren i hænde senest

fredag den 22. februar kl. 12.00.

Bidrag bedes sendt til:

Meddelelsen, v/Helle Doré Hansen (HAnd)
Novo Nordisk A/S
Novo Alle
2880 Bagsværd.

eller med e-mail til: HAnd@novonordisk.com

medinfo@dsts.dk skal benyttes ved indmeldelse og adresseændring i DSTS.

Bidrag i elektronisk form ønskes helst i et af nedenstående formater: Word, PDF, HTML eller ASCII.

Annoncering af stillinger er kr. 500 pr. side

MEDDELELSER

Dansk Selskab for Teoretisk Statistik

Generalforsamling i DSTS Tirsdag d. 26. februar 2002, kl. 17.00 H.C. Ørsted Institutttet, Aud 4

Dagsorden og beretning findes på side 3 til 5.

Efter generalforsamlingen kl. ca. 17.15 er der:

Foredrag i selskabet

Statistikmiljøet R

Peter Dalgaard
Dept. of Biostatistics
University of Copenhagen

R er et generelt statistiksystem som er tilgængeligt under GPL licensen (dvs. fri software, ligesom for eksempel Linux) og har fundet ganske stor udbredelse i de senere år.

R er et højniveausprog, en dialekt af S. Men det er mere end som så, det er et sæt af værktøjer til grafik, numeriske metoder og statistiske analyser, som tilsammen udgør en ramme for statistisk arbejde på alle niveauer.

R gør det muligt for brugere at skrive egen kode af høj kvalitet og distribueret den blandt kolleger. En vigtig del af R er pakkesystemet som sætter en standard for bruger-pakker som det er rimeligt let for forfatterne at opfylde. Dette bidrager dels til kvalitets sikring af koden og dels til at gøre det let at installere den for andre.

Et hyppigt tema er at få R til at tale med andre systemer og programmeringssprog. Fri programsystemer til fx. dataoaser, gør det muligt at genbruge software som ellers ville kræve en kolossal indsats at skrive til R.

Jeg vil fortælle om den konkrete udvikling af R og min egen del heri. Desuden vil jeg diskutere den rolle som statistisk programmering spiller i udviklingen af statistisk teori og praksis, og give et bud på fremtidsperspektiverne.

Øl og evt. spising med foredragsholderen bagefter på B arcéom. Både der har lyst.
Tilmelding til spising skal ske til kassereren på e-mail erhansen@math.ku.dk

Selskabets bestyrelse:

Formand: Bjarne Højgaard Institut for Matematiske Fag Aalborg Universitet Frederik Bajersvej 7 9200 Aalborg Øst	Tlf: 9635 8927 Fax: 9815 8129 e-mail: bjh@math.auc.dk
Kasserer Ernst Hansen Afdeling for Teoretisk Statistik Københavns Universitet Universitetsparken 5 2100 København Ø	Tlf: 3532 0773 Fax: 3532 0772 e-mail: erhansen@math.ku.dk
Redaktør: Helle Doré Hansen Novo Nordisk A/S Sauntesvej 13 2820 Gentofte	Tlf: 4443 8780 Fax: 4443 7040 e-mail: Hand@novonordisk.com
Sekretær: Inge Riis Korsgaard Afd. For Husdyravl og Genetik Forskningscenter Foulum Postbox 50 8830 Tjele	Tlf: 8999 1217 Fax: 8999 1300 e-mail: IngeR.Korsgaard@agrsci.dk
Næstformand: Henrik Madsen Institut for Matematiske Modellering Bygning 321 DTU 2800 Kgs. Lyngby	Tlf: 4525 3408 Fax: 4588 2673 e-mail: hmm@imm.dtu.dk
Webmaster: Henrik Stryhn Department of Health Management Atlantic Vet. College, University of P.E.I. Charlottetown PE, C1A 4P3, Canada	Tlf: (1-902) 894-2847 Fax: (1-902) 566-0823 e-mail: hes@dina.kvl.dk

Selskabets www-adresse: [Http://www.dsts.dk](http://www.dsts.dk).

Generiske e-mail-adresser i selskabet:

Formand: fmd, formand, chair, chairman **Kasserer:** kass, kasserer, treas, treasurer

Redaktør: red, redaktoer, edit, editor **Sekretær:** sekr, sekretaer, secr, secretary

Webmaster: web, webmaster, www

Meddelelser: medd, meddelelser, news1, newsletter

Bestyrelsen: best, bestyr, bestyrelse, board

medlinfo@dsts.dk skal benyttes ved indmeldelse og adresseændring i DSTS.

Generalforsamling i DSTS Tirsdag den 26. februar 2002, kl. 17.00 Auditorium 4, H.C. Ørsted Institut

DAGSORDEN

1. Valg af dirigent
2. Bestyrelsens beretning for 2001 fremlægges til godkendelse
3. Regnskabet for 2001 fremlægges til godkendelse
4. Valg af medlemmer til bestyrelsen
På valg er: Ernst Hansen, Helle Dore Hansen og Henrik Madsen. Ernst Hansen og Helle D. Hansen har begge siddet i to perioder og kan ikke genvælges. Bestyrelsen foreslår at Henrik Madsen genvælges og at Helle Sørensen og Judith L. Jacobsen nyvælges.
5. Valg af revisor
Bestyrelsen foreslår at Kirsten Frederiksen genvælges
6. Behandling af fremsendte foreslag
7. Fastsættelse af næste års kontingent
Bestyrelsen foreslår at kontingentet fastholdes på 200 kr. (100 kr. for studerende og pensionister)
8. Eventuelt

Forslag til punkterne 4, 5 og 6 fremsendes til formanden Bjarne Højgaard, Institut for Matematiske Fag, Aalborg Universitet, Frederik Bajersvej 7G, 9220 Aalborg Ø, så han har dem i hænde senest den 13. februar 2001.

Bestyrelsens beretning findes på de følgende sider.

Bestyrelsens beretning for 2000

Inge Riis Korsgaard blev valgt på den ordinære generalforsamling den 27. februar 2001. Henrik Stryhn og Bjarne Højgaard blev genvalgt. Morten Frydenberg takkedes for sit arbejde i bestyrelsen som mangeårig redaktør af Meddelelser. Kirsten Frederiksen blev genvalgt som revisor. Bestyrelsen konstituerede sig sidenhen med Bjarne Højgaard som formand, Henrik Madsen som næstformand, Ernst Hansen som kasserer, Helle D. Hansen som redaktør af Meddelelser, Inge R. Korsgaard som sekretær og Henrik Stryhn som web-ansvarlig.

Der blev i 2001 afholdt **2 aftensmøder**

Eva Vedel Jensen: A continuous parametric shape model (27/2).

Mogens Bladt: An overview of the method of phases in probability and statistics (11/12).

I samarbejde med Institut for Matematik og Fysik, KVL afholdtes den 27. september halvdagsmøde med temaet "Chemometrics and statistics" med følgende foredrag:

Rolf Sundberg: Statistics in general - statistics in chemistry - chemometrics.

Rasmus Bro: Multi-way analysis - A new tool for solving fundamental model problems in spectroscopy, signal processing etc.

Harald Martens: The versatile PLS Regression

Der blev afholdt **todagsmøde** på Aalborg Universitet den 8. - 9. maj med følgende foredrag:

Ed Wegman: Visual data mining.

Søren Asmussen: Extreme values and rare events for queues and regenerative processes

Thomas Mikosch: Poisson limits for U-statistics

Henrik Madsen: Estimation of extreme hydrologic events

Endvidere var der en fremvisning af AAU's faciliteter til visual 3D data mining.

Der blev afholdt **todagsmøde** på DTU den 13.- 14. november med følgende foredrag:

Philip Brown: Bayesian developments in chemometrics and variable selection

Marcel F. Neuts: The Markovian Arrival Process properties, algorithms and statistical procedures

Kaj Madsen: What can Interval Arithmetic do for you?

Georg Lindgren: New concepts and computational tools for extremes and crossings

Ove Ditlevsen: Stochastic model for joint wave and wind loads on offshore structures

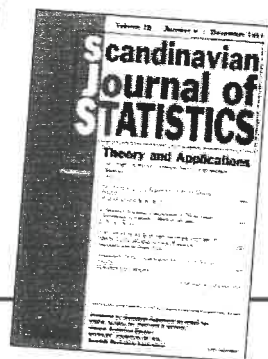
Thomas Scheicke: The additive nonparametric and semiparametric Aalen model as the rate function for counting processes.

Selskabet figurerede endvidere som sponsor ved Rasch Symposiet afholdt på Handelshøjskolen i København, 20 - 22 september, 2001.

Der var god tilslutning til halvdagsmødet. Vi må dog konstatere at der er en mindre nedgang i tilslutningen til todagsmøderne. Det er dog ikke bekymrende og bestyrelsen vil arbejde videre med at der arrangeres halvdagsmøder og todagsmøder i fremtiden.

Meddelelser fra DSTS er udkommet med 9 numre i 2001.

Scandinavian Journal of Statistics



Reduced subscription rates including free online access for members of the Danish Society for Theoretical Statistics, the Finnish Statistical Society, the Norwegian Statistical Society and the Swedish Statistical Association

Scandinavian Journal of Statistics: Theory and Applications is internationally recognised as one of the leading statistical journals in the world. It is devoted to reporting significant and innovative original contributions to statistical methodology, both theory and applications. It specialises in statistical modelling showing particular appreciation of the underlying substantive research problems.

Ranked 25/69 in Statistics and Probability in the Sciences Citation Index

- innovative and original research contributions to statistical methodology
- international articles on all aspects of theoretical and applied statistics
- path breaking developments in such areas as survival and longitudinal analysis, regression, graphical models, likelihood theory, statistics for diffusion processes, times series and analysis of spatial data

RECENT PAPERS

On Quasi Likelihood Equations with Non-parametric Weights
Bing Li, Pennsylvania State University

The Consistency of Estimators in Finite Mixture Models
R. C. H. Cheng and W. B. Liu, University of Kent

The Cusum of Squares Test for Scale Changes in Infinite Order Moving Average Processes
Sangyeol Lee and Siyun Park, Seoul National University

Truncated Poisson Regression for Time Series of Counts
Konstantinos Fokianos, University of Cyprus

Boundary and Bias Correction in Kernel Hazard Estimation
Jens Perch Nielsen, Codan, Copenhagen and Carsten Tanggaard, The Aarhus School of Business, Copenhagen

Exact Non-parametric Confidence Intervals for Quantiles with Progressive Type-II Censoring
Olivier Guilbaud, AstraZeneca, Sweden

For contents, abstracts and subscription information visit
<http://www.blackwellpublishers.co.uk/journals/sjs>

TO ORDER

Scandinavian Journal of Statistics, Volume 29, 2002, ISSN: 0303-6898, (4 issues and online access),
REDUCED MEMBER RATES ○ £18.00 UK/Europe ○ US\$29.00 The Americas ○ £18.00 Rest of World

CONTACT

Paula O'Connor, Blackwell Publishing, 108 Cowley Road, Oxford, OX4 1JF, U.K.
Email: poconnor@blackwellpublishers.co.uk

StatsWeb the new online tool from Blackwell Publishers enables you to search rapidly across the articles and authors in leading statistics journals. Visit: <http://www.statsjournalweb.com>

SEMINAR I MATEMATISK STATISTIK OG SANDSYNLIGHEDSREGNING.

Seminarerne afholdes kl. 15:15 i auditorium 10 på H.C. Ørsted Institutet.
Der serveres te i lokale E325 kl. 15:00.

Onsdag den 6. februar

Charlotte Strunk Hansen (Stern School of Business, New York University)
The Telescoping Overlap Problem in Options Data.

In analyzing the relation between implied and realized volatility, researchers confront samples that have a high degree of overlap, which "telescopes" as option maturities are reached. With volatility samples of this nature, we show that the regression coefficients are disperse even in the limit, the *t* statistics diverge, the Durbin-Watson statistic converges to zero, and the regression *R*² converges to a positive random variable in the limit. We develop an alternative asymptotic theory that accounts for both the high degree of overlap and its telescoping nature, and illustrate it empirically with an application to S&P 100 (OEX) index options. Our theory reconciles the seemingly contradictory results from overlapping and non-overlapping samples, and suggests that option markets aggregate volatility information efficiently, as suggested by the (statistically consistent) results from non-overlapping samples. (Joint work with B.J. Christensen and N.R. Prabhala).

SJS Prize of DKK20000 for Young Statisticians

Scandinavian Journal of Statistics (SJS) is a non-profit organisation established by the Nordic statistical associations, and run by a Board appointed by these associations. In 2000 the Board established the SJS Prize. The prize is bi-annual, and is currently of DKK20000. The prize is awarded to the young statistician presenting the best paper at a bi-annual Nordic Conference on Mathematical Statistics. The paper should be submitted to the SJS during the relevant year (2002) and accepted for publication. The jury consists of the chief editor and the four national editors of SJS. Young statisticians are in this context people of at most 35 years of age when they present their paper at the Nordic conference. A young statistician wanting to compete for the prize must declare his or her bid (and date of birth) when submitting to SJS the paper that has been presented at the Nordic conference, possibly by poster.

The prize comes with a diploma, and is announced at the subsequent bi-annual conference. The first prize (for 2000) will be awarded at the 19th Nordic Conference on Mathematical Statistics, June 9-13, 2002, Stockholm