

BREV
Ukonvoluteret

PP
Danmark

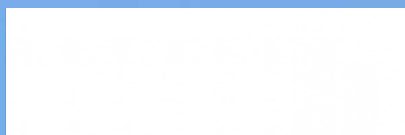
Returneres ved varig adresseændring

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

Bidrag til dette nummer skal være redaktøren i hænde senest

tirsdag den 22. oktober kl. 12.00.

Bidrag bedes sendt til:



medlinfo@dts.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. Indstik, der ønskes sendt i konvolut sammen med Meddelelser, kr. 1500 pr. standard A4 side.

MEDDELELSER

Dansk Selskab for Teoretisk Statistik

Scandinavian Journal of Statistics Prisen

Helle Sørensen modtog den 12. juni 2002 i Stockholm Scandinavian Journal of Statistics Prisen på 20.000 kroner for sin artikel "Simulated Likelihood Approximations for Stochastic Volatility Models". Artiklen er baseret på en del af hendes Ph.D. afhandling, som hun udarbejdede ved Afdeling for Statistik og Operationsanalyse, Institut for Matematiske Fag under vejledning af Martin Jacobsen.

I sit prisbelønnede arbejde har Helle Sørensen arbejdet med en statistisk modeltype, der er vigtig ved analyse af finansielle data som aktiekurser, renter eller valutakurser - de såkaldte stokastiske volatilitetsmodeller. Eksakt likelihood inferens er i forbindelse med denne modeltype meget beregningstung, og det er endnu ikke lykkedes at vise de sædvanlige asymptotiske resultater for maksimum likelihood estimatoren. Helle har derfor foreslået en approksimation til likelihood funktionen, som både er let at beregne og har gode asymptotiske egenskaber.

TILLYKKE

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: Helle Sørensen Økonomisk Institut Københavns Universitet Stuistræde 6 1455 København K	Tlf: 35 32 30 22 Fax: 35 32 30 00 e-mail: helle@econ.ku.dk
Redaktør: Judith L Jacobsen Novo Nordisk A/S Novo Allé 2880 Bagsværd	Tlf: 4442 1637 Fax: 4442 1065 e-mail: JLJa@novonordisk.com
Sekretær: Inge Riis Korsgaard Afd. For Husdyravl og Genetik Forskningsscenter 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: hm@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: find, formand, chair, chairman **Kasserer:** kass, kasserer, treas, treasurer

Redaktør: red, redaktør, edit, editor **Sekretær:** sekr, sekretær, secr, secretary

Webmaster: web, webmaster, www

Meddelelser: medd, meddelelser, newsl, newsletter

Bestyrelsen: best, bestyr, bestyrelse, board

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

DONATION PRAGUE MATHEMATICS AND STATISTICS LIBRARY RECOVERY

The recent flooding heavily hit the Prague city district of Karlín, where the Library of the Faculty of Mathematics and Physics of the Charles University (Sections "Mathematics" and "Computer Science") is situated. Part of this library consists of extremely valuable historical prints, some of which date back to as early as the 17th century. More than 70 percent of all books and journals in the library were under water for more than three days. Recovery of the books and journals, if at all possible, will be complicated and costly. The Faculty of Mathematics and Physics is determined to put forth its best effort to save them; in addition to other steps, it decided to organise a public donation. If you feel you are able and willing to help, you can either:

Transfer money to the following bank account (preferably in EUR):

Account title: Charles University in Prague

Account No.: 01256280/0300

Bank: CSOB a.s., Na Porici 24, 115 20 Praha 1

SWIFT code: CEKO CZ PP

Variable symbol: 900 (please do not forget to pay the transfer fees and to include the variable symbol in the details of your payment) and/or

Donate to the library any mathematics or statistics books or journals you can spare, sending them to the address MFF UK, Library, Sokolovska 83, 186 75 Praha 8, Czech Republic.

In order to get an impression of the damages via a series of photos, please have a look at http://siprint.utia.cas.cz/24_cms/main.html click on "Flood" and then on "Donation - maths library recovery".

Baltic-Nordic Conference on Survey Sampling. Ammarnäs, Sverige, 17-23. August 2002.

Af Michael Davidsen, Statens Institut for Folkesundhed

Denne konference handlede om 'Survey Statistics', et i Danmark ikke særligt opdyrket område, og havde deltagere primært fra de baltiske og nordiske lande, heraf 3 fra Danmark. De 75 deltagere kom fra flere forskellige institutioner, hovedparten fra statistiske afdelinger ved forskellige universiteter og fra nationale statistik-organisationer.

Konferencen havde 3 førende eksperter indenfor området som hovedtalere: Jon N. Rao (Canada), Danny Pfefferman (Israel) og Carl-Erik Särndal (Canada). Disse foredragsholdere gav et bredt overblik over området. Derudover var der 9 inviterede foredrag og en række 'contributed'.

Konferencen var fremragende arrangeret af Matematisk-Statistisk Afdeling ved Umeå Universitet. Alle deltagere boede på et hotel i den lille nordsvenske bjergby, hvilket skabte en god stemning. Det var spændende og inspirerende at deltage. Program og mange af foredragen kan ses på konferencens website www.matstat.umu.se/banocoss.

Litteratur: Särndal C-E, Swensson B, Wreitan J (1992): Model-assisted Survey Sampling. Springer, New York

SEMINAR I MATEMATISK STATISTIK OG SANDSYNLIGHEDSREGNING.

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

Onsdag den 2. oktober
Computational RNA biology
Jan Gorodkin (KVL)

RNA and its structure plays a variety of important roles in cells and *vira*. These are carried out by non-coding RNA genes as well as gene regulatory regions adjacent to protein encoding genes. The search for non-coding RNA genes and RNA structure is often driven by experimental approaches, but computational schemes seems to be increasingly important, in particular in the light of the vast amount of data generated from numerous genome projects. Examples of RNA function and genes will be given, and computational approaches described.

Onsdag den 9. oktober
Marc Yor (University of Paris 6)
Title and abstract will be announced later

FREDAG den 11. oktober
Nonparametric estimation of an additive model with a link function
Joel Horowitz (Northwestern University)

This paper is concerned with nonparametric estimation of the functions m_1, \dots, m_d in the model $Y = F(\mu + m_1(X^1) + \dots + m_d(X^d)) + U$, where X^j ($j=1, \dots, d$) is the j 'th component of the random vector $X \in \mathbb{R}^d$ for some finite $d \geq 2$, F is a known function, μ is an unknown constant, m_1, \dots, m_d are unknown functions and U is an unobserved random variable satisfying $E(U|X=x)=0$, for almost every x . Estimation is based on a random sample $\{Y_i, X_i : i=1, \dots, n\}$ of (Y, X) .

We describe an estimator of the additive components m_1, \dots, m_d that converges in probability pointwise at the rate $n^{-2/5}$ when F and the m_j -s are twice differentiable and the second derivatives are sufficiently smooth. In contrast to previous estimators only two derivatives are needed regardless of the dimension of X , so asymptotically the estimator has no curse of dimensionality. The centered, scaled estimator of each additive component is asymptotically normally distributed with the same mean and variance that it would have, if the other components were known. The results of some Monte Carlo experiments illustrate the finite sample performance of the estimator.

Biostatistisk samarbejde i Øresundsregionen

Medicon Valley Academy har desværre ikke kunnet meddele lokalitet for mødet om Biostatistisk samarbejde i Øresundsregionen. De regner med at have program og lokaleoplysninger på deres hjemmeside snarest. Se www.mva.org

Tilmelding og nærmere program vil muligvis blive udsendt i en separat udsending.



Medicinsk Statistik

Har du brug for konsulentassistance til datamanagement og statistik
..... så ring og hør nærmere.
Ingen opgave er for lille og (næsten) ingen er for stor.

UNI•C Medicinsk Statistik rådgiver og yder konsulentassistance med hensyn til datamæssige og statistiske problemstillinger i relation til medicinske og sundhedsvidenskabelige undersøgelser, herunder kliniske forsøg.

UNI•C Medicinsk Statistik er en kompetent partner med mange års erfaring inden for:

- Kliniske forsøg: planlægning, datamanagement, statistisk analyse og rapportering
- Epidemiologiske studier, herunder anvendelse af registre
- Kliniske databaser
- Medicinske kvalitetsdatabaser, bl.a. med web-brugergrænseflade

UNI•C Medicinsk Statistik har et nært samarbejde med en række medicinalvirksomheder og danske sygehuse.

Få yderligere information hos afdelingsleder Leif Spange Mortensen,
Leif.Spange.Mortensen@uni-c.dk, telefon 89 37 66 66, www.statistik.uni-c.dk

Statistiker Seniorforsker/forsker

Danmarks Veterinærinstitut, Afdeling for Patologi og Epidemiologi søger en statistiker med tiltrædelse snarest. Arbejdssted er København.

Arbejdsopgaver

Statistisk/epidemiologisk analyse og metodeudvikling i form af opgørelse af store datasæt med komplicerede hierarkiske strukturer under anvendelse af relevante teknikker som f.eks. blandede modeller for såvel kontinuerte som diskrete data. Endvidere multidisciplinært samarbejde med henblik på udvikling af kvantitative modeller for introduktion og spredning af eksotiske husdyrsygdomme ved hjælp af simuleringer under anvendelse af klassisk og baysiansk inferens.

Kvalifikationer

Cand.scient. (statistik), cand.stat. eller lignende med dokumenterede kvalifikationer i anvendt statistik. Erfaring med statistisk programmel og håndtering af større datamængder, selvstændighed samt gode samarbejdsevner vil være en fordel, ligesom ansøgeren forudsættes af have en solid fundering i sandsynlighedsfordelinger anvendt i statistikken.

Stillingen er en fuldtidsstilling med løn- og ansættelsesvilkår i henhold til overenskomst for akademikere.

En udførlig stillingsbeskrivelse, som er nødvendig for udarbejdelse af ansøgning, kan rekvireres fra DVI's hjemmeside www.vetinst.dk eller ved henvendelse til DVI's personalekontor, Bülowvej 27, 1790 København V, tlf. 3530 0131. Ved henvendelse opgives j.nr. 33142-0288. Ansøgningsfrist er 25. oktober 2002 kl. 12.

DVI opfordrer alle kvalificerede til at søge stillingen uanset alder, køn, race, religion eller etnisk tilhørsforhold.

Danmarks Veterinærinstitut (DVI) er en sektorforskningsinstitution under Ministeriet for Fødevarer, Landbrug og Fiskeri. DVI er en del af det veterinære beredskab og har som målsætning at bidrage til forebyggelse og bekæmpelse af husdyrsygdomme, zoonoser og antibiotikaresistens. Institutets vision er at have et forudseende beredskab vedrørende fødevarer og husdyrsundhed. DVI har ca. 500 medarbejdere. Læs mere om DVI på www.vetinst.dk

Kalender 2002

(arrangementer annonceret i MEDDELELSER)

Dato	Med. nr.	Aktivitet
1/10	7/02	Kollokvium HCØ: Jostein Paulsen, University of Bergen: Optimal dividend payouts for diffusions with solvency constraints
2/10	6/02	Seminar HCØ: Jan Gorodkin (KVL): Computational RNA biology
9/10	7/02	Seminar HCØ: Marc Yor (University of Paris 6)
11/10	7/02	Seminar HCØ: Joel Horowitz (Northwestern University): Nonparametric estimation of an additive model with a link function
17-18/10	6/02	The Second T.N. Thiele Symposium on Financial Econometrics
31/10	6/02	Møde om Biostatistisk samarbejde i Øresundsregionen
19-20/11	6/02	2-dages møde i Århus
5/12	6/02	Event history analysis and the cross section
15-19/6 2003	6/02	Conference: Spruce VI, Department of Mathematical Statistics, Lund, Sweden

Deadlines i år 2002

Frist for indlevering af bidrag:

22. oktober kl. 12

22. november kl. 12

MEDDELELSER udkommer

1. november

1. december

KØBENHAVNS UNIVERSITET
FORSIKRINGSMATEMATISK LABORATORIUM
COLLOQUIUM IN ACTUARIAL MATHEMATICS

INSTITUT FOR MATEMATISKE FAG

Tue Oct 1 2002 at 16:15 in Aud. 9

Optimal dividend payouts for diffusions with solvency constraints

Jostein Paulsen, University of Bergen

We consider a company where surplus follows a diffusion process and whose objective is to maximize expected discounted dividend payouts to the shareholders. It is well known that under some reasonable assumptions, optimality is achieved by using a barrier strategy, i.e. there is a level b so that whenever surplus goes above b , the excess is paid out as dividends. However, the optimal level b may be unacceptably low, and the company may be prohibited, either by internal clauses or by external reasons such as solvency restrictions imposed on an insurance company, to pay out dividends unless the surplus has reached a higher level $c > b$. We show that in this case a barrier strategy at c is optimal. Finally, it is discussed how the barrier c can be determined, and we suggest to use arguments from risk theory. More concretely, we let c be the smallest barrier so that the probability that the surplus will be negative within a time horizon T is below some given value ϵ when initial surplus equals c . It is shown how c can be calculated using this method, and examples are given for two special cases.

Annonceringen findes på siden <http://www.math.ku.dk/cal/events/1364.htm>

Indbydelse til Medicon Valley Academy seminar

"Biostatistik i Øresundsområdet"

Hvornår: torsdag den 31 oktober, 2002, kl. 9.30 - 15.00.

Sted: SAS Institute, Købmagergade 7-9, København.

Program:

- | | |
|---------------|--|
| 9.30 - 9.45 | Velkomst
(SAS Institute, Medicon Valley Academy, Niels Keiding & Ulf Strömberg) |
| 9.45 - 10.30 | Biostatistik på universiteterne - situationen i Øresundsområdet
(Niels Keiding, Ulf Strömberg, Jonas Björk) |
| 10.30 - 11.30 | Biostatistik i lægemiddelsindustrien – behov for kurser og samarbejde
(Judith L. Jacobsen, Anders Kjällén) |
| 11.30 - 12.00 | Korte præsentationer af kursusvirksomhed
(Bjarne Nielsen, Niels Keiding, Anna Lindgren) |
| 12.00 - 13.00 | Frokost med posterpræsentationer fra biostatistikmiljøerne på universiteterne, i lægemiddelsindustrien og på andre forskningsinstitutioner |
| 13.00 - 14.15 | Gruppediskussioner omkring samarbejde, kursusvirksomhed og metodeudviklingsprojekter, inklusive PhD projekter |
| 14.15 - 15.00 | Opsummering, nedsættelse af arbejdsgrupper |

Tilmeldelse til "Biostatistik i Øresundsområdet"

Fax nedanstående till +45 33 21 10 31 *eller* send en email till biostatistik@mva.org (Subject: Deltager Biostatistik Seminar) *med følgende oplysninger:*

Titel + Navn:
Institution/firma:
Afdeling:
Adresse:
Tlf: Fax:
E-mail:

Tilmelding snarest, og senest den 25-10-2002. Deltagerantallet er begrænset til cirka 60 personer.

Seminariet sponsoreres af

SAS Institute www.sas.com/offices/europe/denmark/index.html

Hjertelig Velkommen!

Niels Keiding (nk@biostat.ku.dk), for planlægningskomiteen

Niels Gerner Larsen (ngl@mva.org), Medicon Valley Academy