

BREV
Ukonvoluteret



Returneres ved varig adresseændring

Næste nummer af "MEDDELELSER" udkommer 1. marts 2003.

Bidrag til dette nummer skal være redaktøren i hænde senest

fredag den 22. februar kl. 12.00.

Bidrag bedes sendt til:

Meddelelser, v/Judith L. Jacobsen (JLJa)
Novo Nordisk A/S
Novo Allé
2880 Bagsværd.
eller med e-mail til: JLJa@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. Indstik, der ønskes sendt i konvolut sammen med Meddelelser, kr. 1500 pr. standard A4 side.

MEDDELELSER

Dansk Selskab for Teoretisk Statistik

**Generalforsamling i DSTS
Tirsdag d. 25. februar 2003, kl. 17.00
H.C. Ørsted Instituttet, Aud 10**

Dagsorden og beretning findes på side 3 til 5.

Efter generalforsamlingen kl. ca. 17.15 er der:

Foredrag i selskabet

Hvornår kan man finde fordelingen af tiden til ruin?

Martin Jacobsen
Dept. of Statistics
University of Copenhagen

I risikoteori studerer man stokastiske processer, der starter med at være positive og hvor ruintidspunktet T er første gang processen bliver negativ. Typisk sker ruin ved at processen via et spring nedad passerer 0 og der optræder så et 'undershoot' som er processens værdi til tid T , og som er negativt og stokastisk. Dette 'undershoot' gør det ekstra svært at bestemme fordelingen af T , og de resultater der findes i litteraturen er ofte approksimationer og handler mere om selve sandsynligheden for ruin snarere end fordelingen af T .

Det viser sig dog, at man for forskellige typer af modeller faktisk kan give en eksakt beskrivelse af fordelingen af T , f.eks. ved at bestemme den Laplace-transformerede. En klassisk, men effektiv, metode består i at bruge martingaler og stoppetider. I foredraget belyses metoden ved nogle simple eksempler: den klassiske risikomodell, Brownske bevægelser med spring samt hasardspil efter den berømte strategi hvor indsatsen fordobles efter hvert tab - det sidste for at vise, at det er muligt at komme igennem i et eksempel der umiddelbart virker helt håbløst!

Øl og evt. spisning med foredragsholderen bagefter på Barcelona for de der har lyst. Tilmelding til spisning skal ske til kassereren på e-mail helle@dina.kvl.dk senest dagen før.

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 Studiestræde 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: 4443 8780 Fax: 4443 7040 e-mail: JLJa@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: 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: 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, newsl, newsletter
Bestyrelsen: best, bestyr, bestyrelse, board

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

Generalforsamling i DSTS Tirsdag den 25. februar 2003, kl. 17.00 Auditorium 10, H.C. Ørsted Instituttet

DAGSORDEN

1. Valg af dirigent
2. Bestyrelsens beretning for 2002 fremlægges til godkendelse
3. Regnskabet for 2002 fremlægges til godkendelse
4. Valg af medlemmer til bestyrelsen
På valg er: Inge R. Korsgaard, Henrik Stryhn, Bjarne Højgaard. Henrik Stryhn og Bjarne Højgaard har begge siddet i to perioder og kan ikke genvælges. Bestyrelsen foreslår at Inge R. Korsgaard genvælges og at Per Bruun Brockhoff og Kim Emil Andersen 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 12. februar 2002.

Bestyrelsens beretning findes på de følgende sider.

Bestyrelsens beretning for 2002

Helle Sørensen og Judith L. Jacobsen blev valgt på den ordinære generalforsamling den 26. februar 2002. Henrik Madsen blev genvalgt. Ernst Hansen og Helle Doré takkedes for deres arbejde som henholdsvis kasserer og redaktør for selskabet. Kirsten Frederiksen blev genvalgt som revisor. Bestyrelsen konstituerede sig sidenhen med Bjarne Højgaard som formand, Henrik Madsen som næstformand, Helle Sørensen som kasserer, Judith L. Jacobsen som redaktør af Meddelelser, Inge Riis Korsgaard som sekretær og Henrik Stryhn som web-ansvarlig.

Der blev i 2002 afholdt **2 aftenmøder**

Peter Dalgaard: Statistikmiljøet R (26/2).

Steffen L. Lauritzen: Probabilistic Expert Systems for DNA Mixture Profiling (12/12).

I samarbejde med Novo Nordisk afholdtes den 1. maj halvdagsmøde med temaet "Statistiske udfordringer indenfor PK/PD" med følgende foredrag:

Peter Veng-Pedersen: An introduction to Pharmacokinetics and Pharmacodynamics in Pharmaceutical R & D.

Lars Erichson: Simulation of clinical trials.

Jørn Atterman: Estimation of pharmacokinetic parameters with interindividual variation.

Claus Dethlefsen og Susanne G. Bøttcher: Bayesian Networks used in PK/PD modelling.

Kim E. Andersen og Malene Højbjerg: A Bayesian approach to Bergmans Minimal Model for glucose and insulin kinetics.

Der blev afholdt Nordisk Møde i Juni i Stockholm, Sverige. Derfor afholdtes kun et **todaysmøde** i 2002. Dette var på Biostatistisk afdeling, Århus Universitet den 19.–20. november med følgende foredrag:

Erik Parner: Interval-censored data with applications.

Anders Skrdal: Estimation and prediction in generalized linear latent and mixed models: A practical perspective.

Claus Dethlefsen: Space-time problems and applications.

Esbén Agerbo: Using Danish registers in psychiatric epidemiology.

Jens Ledet Jensen: Microarrays: A case for statistical smagsdommere*.

* Arbiters of taste

Claus Ekstrøm: Linkage analysis of quantitative traits.

Bestyrelsen glæder sig over at, der i 2002 har været god tilslutning til halvdags- og todaysmøderne.

Meddelelser fra DSTS er udkommet med 9 numre i 2002.



STATENS
SERUM
INSTITUT

Til Biostatistisk afdeling søges en statistiker til ansættelse snarest. Biostatistisk afdeling er en serviceafdeling, som yder statistisk rådgivning og udfører statistiske analyser i de forsknings- og udviklingsprojekter, som instituttet indgår i. Afdelingens hovedopgave er at supportere instituttets produktion og udvikling af lægemidler.

Jobbet

- Planlægning og analyse af produktionsrelaterede valideringsforsøg
- Planlægning og analyse af bioassays, herunder styrkebestemmelse af vacciner
- I samarbejde med Medicinsk afdeling at planlægge, analysere og afrapportere de kliniske forsøg som skal udføres med henblik på at opnå myndighedsgodkendelse af SSIs nye lægemidler
- Generel statistisk rådgivning i forbindelse med forskningsprojekter.

Kvalifikationer

- Statistisk kandidatgrad eller tilsvarende
- Kendskab til SAS-systemet
- Gode skriftlige formuleringsevner (engelsk)
- Kendskab til kliniske forsøg eller validering vil være en fordel.

Løn- og ansættelsesvilkår

I henhold til overenskomsten for akademikere i Staten mellem Finansministeriet og AC. Til stillingen er knyttet kvalifikationstillæg.

Information

Kan fås hos afdelingsleder Anders Mørup Jensen, tlf. 3268 3284.

Ansøgning

Ansøgning mærket "64005575" sendes til Personaleafdelingen senest onsdag den 19. februar 2003. Ansættelsessamtaler forventes afholdt i uge 9/10.

www.ssi.dk

Forskningsassistent i biostatistik

Ved Biostatistisk Afdeling, Københavns Universitet er en stilling som projektlønnet forskningsassistent i et år, med mulighed for forlængelse, til besættelse snarest.

Arbejdet vedrører forskellige medicinsk-statistiske samarbejdsprojekter, mest i epidemiologi og analyse af overlevelsesdata. Ansøgere skal have baggrund som statistiker, eksempelvis cand.scient. eller evt. cand.polyt.

Projektfinsierede statistikere i Biostatistisk Afdeling har traditionelt gode muligheder for faglig videreudvikling, enten gennem senere ph.d.-studier i Afdelingen eller ved at benytte deres erfaring fra Afdelingen som baggrund for en tilfredsstillende indplacering som biostatistiker i erhvervslivet eller i sektorforskningsinstitutioner.

Ansættelse vil ske i henhold til reglerne i cirkulæret om stillingsstruktur ved de højere uddannelsesinstitutioner under Undervisningsministeriet. Der vil således blive nedsat et bedømmelsesudvalg på to medlemmer. Den enkelte ansøger vil få bedømmelsen af sig selv tilsendt.

Ansøgning fremsendes til Professor Niels Keiding, Biostatistisk Afdeling, Københavns Universitet, Blegdamsvej 3, 2200 København N., senest 10. februar 2003 kl. 12.00.

Nærmere oplysninger kan gives af Niels Keiding, tlf. 35 32 79 03.

Aflønning ifølge overenskomst mellem Finansministeriet og AC. Til forskningsassistenter ydes et ikke pensionsgivende tillæg på p.t. kr. 29.053,65 årligt.

SEMINAR I MATEMATISK STATISTIK OG SANDSYNLIGHEDSREGNING.

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

Onsdag den 12. februar:

Bo Markussen (AMS, KU):

Minimal Variation Filtration of Brownian Flows of Diffeomorphisms.

Consider the following problem: Given N pairs $(x_1, y_1), \dots, (x_n, y_n)$ of points in d -dimensional space with $y_n = f(x_n)$, where f is a diffeomorphism from \mathbb{R}^d on \mathbb{R}^d , find f . A satisfactory (!?) answer to this mathematically ill-posed problem is given using probability theory. In the talk the proposed heuristics and ideas as well as an implementation of the resulting algorithm in two-dimensional space will be presented. However, this approach to "Brownian Warps" does not use the the distribution of the underlying stochastic processes and can easily be implemented in any dimension.

Onsdag den 19. februar:

Anders Tolver Jensen (AMS, KU):

Extremal Behaviour over Regenerative Cycles for Reflected Markov Additive Processes with Heavy-tailed Increments.

Reflected additive processes are important processes in many areas of applied probability: the actual waiting time of a GI/G/1 queue as well as the local similarity between two aligned sequences of random letters are examples of reflected random walks. In this talk we consider the extremal behaviour of the maximum over regenerative cycles for a reflected additive process with heavy-tailed increments in the case where the increments are controlled by a Markov chain on a finite state space. We focus on the problems about extending the similar result for random walks with heavy tailed increments to the Markov additive case. This is joint work with Niels R. Hansen (University of Copenhagen).

EURASIP Journal on Applied Signal Processing Special Issue on Multiuser Detection and Blind Estimation

- o The Spirit Will Continue,
K. J. Ray Liu
- o Editorial,
Zhi Ding, Xiaodong Wang, and Marco Lops
- o Blind Adaptive Decorrelating RAKE (DRAKE) Downlink Receiver for Space-Time Block Coded Multipath CDMA,
Sudharman K. Jayaweera and H. Vincent Poor
- o Space-Time Coded MC-CDMA: Blind Channel Estimation, Identifiability, and Receiver Design,
Wei Sun and Hongbin Li
- o Adaptive Transmitter Precoding for Time Division Duplex CDMA in Fading Multipath Channels: Strategy and Analysis,
Daryl Reynolds, Anders Høst-Madsen, and Xiaodong Wang
- o Equivalence of Linear MMSE Detection in DS-CDMA and MC-CDMA Systems over Time and Frequency Selective Channels,
Tamer A. Kadous and Akbar M. Sayeed
- o Multiuser Delay-Tracking CDMA Receiver,
Wei Zha and Steven D. Blostein
- o Blind Reduced-Rank MMSE Detector for DS-CDMA Systems,
Xiaodong Cai, Hongya Ge, and Ali N. Akansu
- o Further Study on MOE-Based Multiuser Detection in Unknown Multipath,
Zhengyuan Xu
- o Reduced-Rank Adaptive Filtering Using Krylov Subspace,
Serguei Burykh and Karim Abed-Meraim
- o Adaptive Near-Optimal Multiuser Detection Using a Stochastic and Hysteretic Hopfield Net Receiver,
Gábor Jeney, János Leventovszky, László Pap, and E. C. van der Meulen
- o Noncoherent Multiuser Communications: Multistage Detection and Selective Filtering,
Rajnish Sinha, Aylin Yener, and Roy D. Yates
- o Multiuser Channel Estimation from Higher-Order Statistical Matrix Pencil,
Jing Liang and Zhi Ding
- o A suboptimal Iterative Method for Maximum Likelihood Sequence Estimation in a Multipath Context,
Olivier Rousseaux, Geert Leus, and Marc Moonen
- o On the Blind Estimation of Baud-Rate Equalizer Performance,
João-Batista Destro-Filho
- o Noise Cancellation with Static Mixtures of a Nonstationary Signal and Stationary Noise,
Sharon Gannot and Arie Yeredor
- o Simultaneous Principal Component Extraction with Application to Adaptive Blind Multiuser Detection,
Deniz Erdogmus, Yadunandana N. Rao, Kenneth E. Hild II

Kalender 2002

(arrangementer annonceret i MEDDELELSER)

Dato	Med. nr.	Aktivitet
12/2	1/03	Seminar HCØ: Bo Markussen (AMS,KU): Minimal Variation Filtration of Brownian Flows of Diffeomorphisms.
19/2	1/03	Seminar HCØ: Anders Tolver Jensen (AMS.KU): Extremal Behaviour over Regenerative Cycles for Reflected Markov Additive Processes with Heavy-tailed Increments.
25/2	1/03	Generalforsamling I DSTS, H.C. Ørsted's Institut, Aud. 10
15-19/6	6/02	Conference: Spruce VI, Department of Mathematical Statistics, Lund, Sweden

Deadlines i år 2003

Frist for indlevering af bidrag:

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

MEDDELELSER udkommer

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

Nyt om navne

Søren Asmussen, Klemens Binswanger og Bjarne Højgård har modtaget

2002 INFORMS Outstanding Simulation Publication Award for deres artikel

"Rare events simulation for heavy-tailed distributions. **Bernoulli** 6, 303-322 (2000)".

Bjarne Højgård har fået prisen for bedste **simulering**. **TILLYKKE!**

Helle Sørensen starter d. 1. februar på KVL, Institut for Matematik og Fysik. Helle kommer fra Økonomisk Institut på Københavns Universitet.

Afdeling for Statistik og Operationsanalyse ved KU har per 1. januar 2003 skiftet navn til Afdeling for Anvendt Matematik og Statistik (AMS). Baggrunden er, at afdelingen nu også omfatter forsikringsmatematik.

Andet nyt

Hvis dit Meddelelser denne måned har en lidt anden farve end Meddelelser plejer at have, er det fordi den oprindelige 'Lavendel'-farve ikke længere er til at opdrive. Redaktøren beklager.

Dansk Selskab for Teoretisk Statistik

Regnskab 2002

Indtægter

Kontingent:

Ordinære medlemmer	309 á 200	61.800	
Pensionistmedlemmer	5 á 100	500	
Studertermedlemmer	9 á 100	900	
Æresmedlemmer	2 á 0	0	
Ukendte betalere	5 á 200	1.000	
For tidligere år (2000 og 2001):	4 á 200	<u>800</u>	65.000,00

Annoncer, MEDDELELSER 12.575,58

Renter:

BG Bank		72,74	
Jyske Bank		<u>2.295,20</u>	2.367,94

Todagesmøde i Århus, november 2002:

Foredragsholdere	6 á 0	0	
Ordinære deltagere	68 á 450	30.600	
Studerter mm.	13 á 225	<u>2.925</u>	33.525,00

Indtægter i alt 113.468,52

Dansk Selskab for Teoretisk Statistik

Regnskab 2002 (fortsat)

Udgifter

MEDDELELSER:

Porto	17.091,50	
Udsendelse	3.800,00	
Tryk	2.748,75	
Papir	<u>1.229,15</u>	24.869,40

Gebyrer:

BG Bank	471	
Jyske Bank	<u>805,58</u>	1.276,58

Porto		242,50
-------	--	--------

Domæne på www		75,00
---------------	--	-------

Bestyrelsesmøder		5.313,74
------------------	--	----------

Generalforsamling		3.846,00
-------------------	--	----------

Julemøde		2.951,00
----------	--	----------

Todagesmøde, Århus, november 2002		38.462,34
-----------------------------------	--	-----------

Vedr. aftenmøde, september 2001		2.442,94
---------------------------------	--	----------

Udgifter i alt		79.479,50
----------------	--	-----------

Kontant overskud		33.989,02
-------------------------	--	------------------

Dansk Selskab for Teoretisk Statistik Regnskab 2002 (fortsat)

Status

Beholdning 31. december 2001	191.942,98
Overskud	33.989,02
<hr/>	
Beholdning 31. december 2002	225.932,00

Beholdningens placering

Jyske Bank, folio		38.945,52
Jyske Bank, aftale		170.000,00
BG Bank		12.770,23
Tilgodehavende:		
Kontingent (10 á 200)	2.000,00	
Gebyr, todagesmøde (6 á 450, 2 á 225)	<u>3.150,00</u>	5.150,00
Skyldig (Tryk, MEDDELELSER)		-933,75
<hr/>		
I alt		225.932,00

Frederiksberg, 24. februar 2003



Helle Sørensen
(Kasserer)



Kirsten Frederiksen
(Revisor)