

6.4 Die Dekade 1994 – 2004

Weil absehbar war, dass Prof. Rüschen-dorf den Ruf nach Freiburg annehmen würde, beauftragte der Fachbereich bereits am 26.08.1993 die Wiederzuweisung der C3-Professur “Mathematische Statistik”. Diesem Antrag gab das Rektorat der WWU mit Schreiben vom 11.11.1993 statt. Die Ausschreibung erfolgte unmittelbar danach; in Hinblick auf das dringende Interesse an der Wiederbesetzung wurde als Bewerbungstermin der 31.01.1994 festgesetzt und die erste Sitzung der Berufungskommission auf den 02.02.1994 terminiert. Bereits am 04.05.1994 konnte die Kommission einstimmig eine Liste verabschieden. Dieser stimmte der Fachbereichsrat des FB Mathematik auf seiner Sitzung am 11.05.1994 ebenfalls einstimmig zu.

Die an erster Stelle stehende

Priv.-Doz. Dr. Claudia Klüppelberg (Zürich)

erhielt jedoch noch vor der Erteilung des Rufes durch das Ministerium für Wissenschaft und Forschung des Landes Nordrhein-Westfalen einen Ruf auf eine C3-Professur für Mathematische Statistik an der Johannes Gutenberg-Universität Mainz und wurde von der Universität Hamburg auf die erste Stelle einer Berufungsliste für eine C4-Professur gesetzt. Dankenswerterweise teilte Frau Klüppelberg dem Fachbereich bereits am 27.06.1994 mit, dass sie unter diesen Umständen auf eine Berufung an die Universität Münster verzichte.¹⁰¹

Der Zweitplatzierte der Berufungsliste

Priv.-Doz. Dr. Gerold Alsmeyer (Kiel)

stand inzwischen auf der ersten Stelle einer Berufungsliste für eine C3-Professur für Mathe-



Prof. Dr. Gerold Alsmeyer

¹⁰¹Frau Dr. Klüppelberg war von 1995 bis 1997 Professorin am Fachbereich Mathematik der Universität Mainz; seit 1997 ist sie ordentliche Professorin am Zentrum Mathematik der Technischen Universität München.

matische Statistik der Universität Trier. In Berufungsverhandlungen mit der Westfälischen Wilhelms-Universität am 08.09.1994 und am 11.10.1994 sowie mit dem Ministerium für Wissenschaft und Forschung am 19.09.1994 konnte jedoch erreicht werden, dass Gerold Alsmeyer den Ruf nach Münster annahm; er wurde mit Wirkung vom 20.10.1994 zum Professor für Mathematische Statistik ernannt.

Gerold Alsmeyer wurde am 05.12.1957 in Burgsteinfurt geboren. Von 1977 bis 1982 studierte er an der Westfälischen Wilhelms-Universität Münster; 1982 erwarb er das Diplom in Mathematik. 1984 wurde er mit der von Albrecht Irle (Christian-Albrechts-Universität Kiel) betreuten Dissertation “Asymptotische Entwicklungen des Erwartungswertes und der Varianz von Stopzeiten mit Anwendungen in der Sequentialanalyse” an der WWU Münster zum Dr. rer. nat. promoviert. Von 1984 bis 1991 war er an der Universität Kiel Wissenschaftlicher Mitarbeiter bzw. C1-Hochschulassistent, dabei vom 01.09.1989 bis zum 31.08.1990 für ein Max-Kade-Stipendium am Department of Statistics der Stanford-University (USA) beurlaubt. 1988 habilitierte er sich in Kiel mit der Schrift “Renewal Theory for Stochastically Bounded Random Walks”. Von 1991 bis 1994 war er C2-Oberassistent an der Universität Kiel.¹⁰²

Mit der Berufung von Prof. Alsmeyer konnte einerseits erreicht werden, dass das umfangreiche Lehrprogramm des Instituts, mit dem die Studierenden zügig an ihre Abschlussarbeiten herangeführt wurden, weiterhin gewährleistet war. Andererseits wurde ein wichtiger neuer Forschungsschwerpunkt (angewandte stochastische Prozesse) etabliert.

Im Jahre 1994 gab es am Institut noch weitere personelle Veränderungen: Bei dem Arbeitsschwerpunkt “Sequentiell geplante statistische Entscheidungsverfahren” des Ref. wechselten die beiden 1993 promovierten Mitarbeiter Dr. D. Kohlruss (am 01.04.1994) zu einer Versicherungsgesellschaft und Dr. I. Terveer (am 01.08.1994) an das Institut für Wirtschaftsinformatik der WWU. Uwe Wortmann wurde im Juli 1994 mit der von Prof. Rüschemann betreuten Dissertation “Konvergenzraten vom Berry-Esséen-Typ normierter Faltungspotenzen von Maßen gegen stabile Maße auf homogenen Gruppen” zum Dr. rer. nat. promoviert. Er wechselte zum 01.08.1994 an den Fachbereich Mathematik der Universität Dortmund. Bei dem Schwerpunkt “Prophetentheorie” des Ref. wurde Herr Dipl.-Math. Friedrich Harten ab dem 01.01.1994 als Wissenschaftlicher Mitarbeiter eingestellt, und schließlich konnte Herr Dipl.-Math. Jens Gebhard im Rahmen des von der Deutschen Forschungsgemeinschaft (DFG) geförderten Projekts Schm 677/5-1 “Permutationstests” des Ref. ab dem 01.09.1994 als Wissenschaftlicher Mitarbeiter eingestellt werden.

Die Veröffentlichungsliste des Instituts umfasste 1994:

- G. Alsmeyer: On the Markov renewal theorem. *Stochastic Process. Appl.* 50 (1994), 37 – 56
- : Blackwell’s renewal theorem for certain linear submartingales. *Acta Appl. Math.* 34 (1994), 135 – 150

¹⁰²Im Jahre 2003 erhielt er einen Ruf auf eine C4-Professur für Mathematische Stochastik an der Philipps-Universität Marburg, den er jedoch im Februar 2004 ablehnte (s. a. S. 199).

- : Recurrence theorems for square-integrable martingales. *Studia Math.* 110 (1994), 221 – 234
- : Random walks with stochastically bounded increments: Renewal theory via Fourier Analysis. *Yokohama Math. J.* 42 (1994), 1 – 12
- D. Kohlruss: Exact Formulas for the OC- and ASN-Functions of the SPRT for Erlang Distributions. *Sequential Anal.* 13 (1994), 53 – 62
- H. Luschgy: Asymptotic inference for semimartingale models with singular parameter points. *J. Statist. Plann. Inference* 39 (1994), 155 – 186
- : Asymptotic behaviour of Neyman-Pearson tests for autoregressive processes. *Scand. J. Statist.* 21 (1994), 461 – 473
- : Asymptotic expansions of error probabilities for tests. *Proc. Fifth Prague Conf. on Asymptotic Statistics 1994*; 369 – 377
- (gem. mit S. Graf): Consistent estimation in the quantization problem for random vectors. *Trans. Twelfth Prague Conf. Information Theory, Statist. Decision Functions, Random Processes 1994*; 84 – 87
- D. Plachky: A statistical property of the arrangements of a finite set. *Statistics* 25 (1994), 271 – 274
- : Order completeness of L^1 with applications to stochastics. *Approx., Probab. and Rel. Fields, Plenum 1994*; 395 – 399
- : Uniqueness and extremal extensions of measures with applications to decomposition of real-valued measures and extension of strongly additive vector measures. *Atti Sem. Mat. Fis. Univ. Modena* 42 (1994), 367 – 378
- N. Schmitz: Minimax Strategies for Discounted “Secretary Problems” with Interview Costs. *ZOR – Methods and Models of Operations Research* 40 (1994), 229 – 238
- : Sequentially planned probability ratio tests: A survey. *Selecta Statistica Canadiana Vol. IX (1994)*, 141 – 160

Am 26. und 27. August 1994 fand – wiederum als “Kompakt-Seminar für Diplom-Mathematiker” – das

4. Alumni-Treffen

der Arbeitsgruppe des Ref. statt; es nahmen über 90 ehemalige bzw. aktuelle Diplomanden/innen teil. Die Vorträge

Dr. K.-H. Baumann (Kölnische Rückversicherung): “CARE – Ein Service der Kölnischen Rück zur Portfeuille-Analyse in der Feuerversicherung”

Dipl.-Math. H. Barth (Berlinische Lebensversicherung Wiesbaden): “Zur Tätigkeit des verantwortlichen Aktuars nach der Deregulierung des Versicherungsmarkts”

Dr. K. Fischer (Citibank Düsseldorf): “Was erwartet uns als Privatkunden der Banken in den nächsten Jahren?”

- Dipl.-Math. P. Grobara (Thiemann Arzneimittel Waltrup): “Logistische Regression bei der Analyse klinischer Prüfungen”
- Dipl.-Math. S. Hein (Mummert + Partner Unternehmensber. Wiesbaden): “DV-Systeme für den deregulierten Versicherungsmarkt”
- Dipl.-Math. J. Heinel (Provinzial-Versicherungen Münster): “Kapitalanlagen Controlling”
- Dipl.-Math. H. Hewel (Unternehmensberatung Hewel Münster): “Qualitätsmanagement in der DV-Branche”
- Prof. Dr. U. Müller-Funk (Institut für Wirtschaftsinformatik, WWU Münster): “Der Taguchi-Approach – Mythos oder Qualitätsmanagement-Strategie?”
- Dipl.-Math. A. Neimanis (Infologistik München): “Individual-Software als international verfügbares Wirtschaftsgut – Erfahrungs-Bericht zur Software-Erstellung in Riga/Lettland”
- Dr. B. Süselbeck (Rechenzentrum der WWU Münster): “S-Plus – von explorativer Datenanalyse zu statistischer Modellierung”

gaben einen hervorragenden Einblick in die breitgespannten Arbeitsgebiete von Mathematikern.



Beim abendlichen Treffen im Gräftenhof

Die Entwicklungen des Jahres 1994 hatten überdies etliche erfreuliche Auswirkungen für 1995: Priv.-Doz. Dr. Harald Luschgy, apl. Professor am hiesigen Fachbereich, erhielt einen Ruf auf eine C3-Professur für Mathematische Statistik an der Universität Trier und nahm diesen zum Sommersemester 1995 an. Am 12.07.1995 wurde Andreas Meyerthole mit der

Dissertation “Spiele gegen einen Propheten bei allgemeinen stochastischen Prozessen” zum Dr. rer. nat. promoviert; er wechselte zum 01.09.1995 zu einer Rückversicherung.



Dr. Andreas Meyerthole

Am 13.10.1995 wurde Jens Gebhard mit der Dissertation “Optimalitätseigenschaften und Algorithmen für Permutationstests” zum Dr. rer. nat. promoviert; er wechselte anschließend zu einem Medienkonzern.



Dr. Jens Gebhard

Zum 01.01.1995 wurde Herr Dipl.-Math. Matthias Brake als Wissenschaftlicher Mitarbeiter im Rahmen der Arbeitsgruppe “Sequentielle Entscheidungsverfahren” des Ref. eingestellt, zum 01.09.1995 Herr Dipl.-Math. Dimitri Bortnik als Wissenschaftlicher Mitarbeiter im Rahmen der Arbeitsgruppe von Prof. Alsmeyer.

An Publikationen erschienen 1995 u. a.

- G. Alsmeyer: Random walks with stochastically bounded increments: Renewal theory. Math. Nachr. 175 (1995), 13 – 31
- J. Gebhard: Optimalitätseigenschaften und Algorithmen für Permutationstests. Dissertation Münster 1995; erschienen als Band 26 der Skripten zur Mathematischen Statistik
- H. Luschgy: Linear estimators and radonifying operators. Theory Probab. Appl. 40 (1995), 205 – 213
- : Local asymptotic quadraticity of stochastic process models based on stopping times. Stochastic Process. Appl. 57 (1995), 305 – 317
- A. Meyerthole: Spiele gegen einen Propheten bei allgemeinen stochastischen Prozessen. Dissertation Münster 1995; erschienen als Band 25 der Skripten zur Mathematischen Statistik
- D. Plachky: Some measure theoretical characterizations of compactness of metric Spaces. Sankhya A 97 (1995), 154 – 157
- : Characterizations of completion regularity of measures. Theory Probab. Appl. 40 (1995), 220 – 225
- (gem. mit F. Schürmann): Characterization of direct Riemann-integrable functions and their dual space. Proc. 14th Intern. Conference on Multivariate Statist. Analysis 1995; 215 – 224
- N. Schmitz: Comments on “Optimality of the Sequential Probability Ratio Test for Non-stationary Observations” by Y. Liu and S. D. Blostein. IEEE Transactions on Information Theory 41 (1995), 861
- : Stein’s two-stage procedure for the intra-class model. Scand. Actuar. J. 1995; 187
- I. Terveer: Cost optimal multistage sampling plans in statistical quality control. Oper. Res. 41 (1995), 359 – 380

Auf Anregung von Herrn Alsmeyer fand am 09. und 10.07.1995 ein

Kiel-Münster-Kolloquium “Mathematische Stochastik”

statt mit den Vorträgen

- N. Schmitz: Spiele gegen einen Propheten (Eine Übersicht),
- A. Meyerthole: Prophetentheorie bei allgemeinen stochastischen Prozessen,
- F. Harten: Prophetenungleichungen bei Bewertungsfunktionen im unabhängigen Fall,
- U. Rösler: Propheten-Spieler-Ungleichungen und die Hardy-Littlewood-Maximalfunktion,
- G. Alsmeyer: Die Aussterbewahrscheinlichkeit für bisexuelle Galton-Watson-Prozesse mit promisker Paarungsfunktion,
- V. Bruhn: Markov-Prozesse mit Erneuerungsanfang,

V. Paulsen: Die Momente des FIND-Algorithmus,
A. Irle: Sequentielle Nächste-Nachbarn-Verfahren,
J. Gebhard: Optimalitätseigenschaften und Algorithmen für Permutationstests,
D. Bortnik: Inkorrekt gestellte Aufgaben in der stochastischen Geometrie.

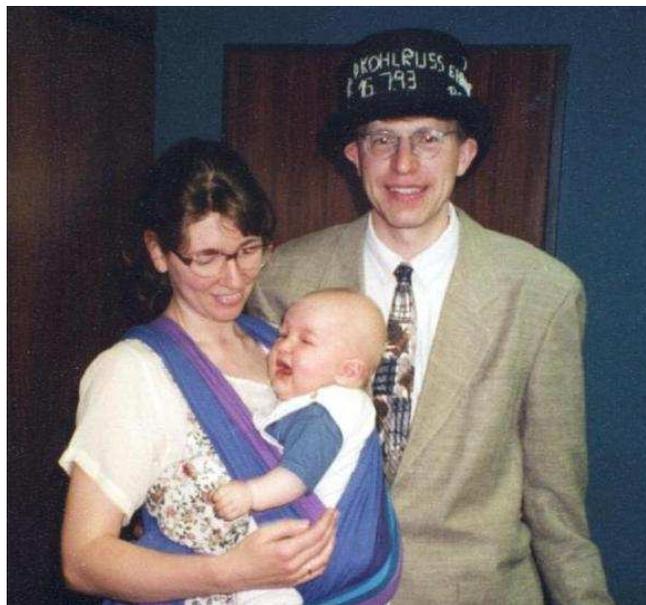
Das Kolloquium fand so positiven Anklang, dass bereits über eine “Gegeneinladung” im Jahr 1996 diskutiert wurde.

Im Jahre 1996 konnten sogar drei Promotionen gefeiert werden: Jürgen Hille wurde am 13.02.1996 mit der Dissertation “Über Suffizienz, Blackwell-Suffizienz und Bayes-Suffizienz”,



Dr. Jürgen Hille

Friedrich Harten am 12.07.1996 mit der Dissertation “Prophetenregionen bei zeitlichen Bewertungen im unabhängigen und im iid-Fall”, und Dimitri Bortnik am 05.12.1996 mit



Dr. Friedrich Harten

der Dissertation “Stochastische Regularisierung und ihre Anwendung auf stochastisch geometrische Schätzprobleme” zum Dr. rer. nat. promoviert.



Dr. Dimitri Bortnik

Zum 01.04.1996 wurde Herr Dipl.-Math. Mathias Müller als Wissenschaftlicher Mitarbeiter im Rahmen der Arbeitsgruppe von Prof. Alsmeyer eingestellt, und ab dem 01.06.1996 konnte Herr Dipl.-Math. Volker Hoefs als Wissenschaftlicher Mitarbeiter im Rahmen des von der DFG geförderten Projekts AL 448/1-1 “Erneuerungstheorie für Summen stationärer m -abhängiger Zufallsgrößen” von Prof. Alsmeyer eingestellt werden. Zum 01.01.1997 wechselte Dr. Friedrich Harten zu einer Versicherungsgruppe.

Prof. Alsmeyer brachte nicht nur ein neues Arbeitsgebiet an das Institut, sondern auch neue Ideen für den “Betriebsausflug”:



Boule auf der Sentruper Höhe (Foto G. Alsmeyer)

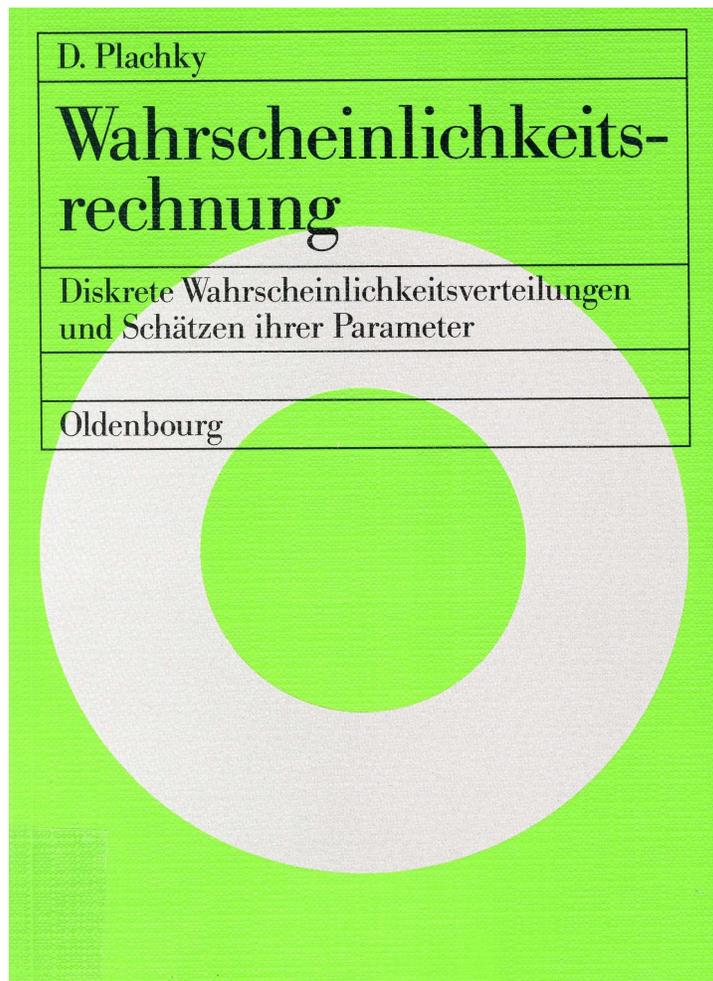
An Publikationen erschienen 1996 insbesondere

- G. Alsmeyer: Nonnegativity of odd functional moments of positive random variables with decreasing density. *Statist. Probab. Lett.* 26 (1996), 75 – 82
- : Superposed continuous renewal processes: A Markov renewal approach. *Stochastic Process. Appl.* 61 (1996), 311 – 322
- (gem. mit U. Rösler): The bisexual Galton-Watson process with promiscuous mating: Extinction probabilities in the supercritical case. *Ann. Appl. Probab.* 6 (1996), 922 – 939
- F. Harten: Prophetenregionen bei zeitlichen Bewertungen im unabhängigen und im iid Fall. Dissertation Münster 1996; erschienen als Band 27 der Skripten zur Mathematischen Statistik
- J. Hille; D. Plachky: Monogenicity of probability measures based on measurable sets invariant under finite groups of transformations. *Kybernetika* 32 (1996), 375 – 387
- D. Plachky: Characterizations of uniform distributions by stochastic ordering. *Proc. 15th Intern. Conf. Multivariate Statist. Analysis 1996*, 25 – 30
- : A useful σ -algebra for counter-examples in probability and statistics. *Tatra Mt. Math. Publ.* 8 (1996), 55 – 59
- (gem. mit K. Obermeyer): Realization of closed, convex, and symmetric subsets of the unit square as regions of risk for testing simple hypotheses. *Metrika* 42 (1995/96), 325 – 329
- (gem. mit A. Dannwerth): On the existence of UMVU estimators for Bernoulli experiments in the non-identically distributed case with applications to the randomized response method and the unrelated question model. *Lecture Notes in Statistics* 114 (1996), 426 – 432
- N. Schmitz (gem. mit B. K. Ghosh): Best linear unbiased estimations of the population mean under sequential sampling. *Sankhya B* 58 (1996), 184 – 198

Insbesondere zum Gebrauch neben der Vorlesung “Stochastik” veröffentlichte Prof. Plachky im Oldenbourg-Verlag München das Lehrbuch

Wahrscheinlichkeitsrechnung
Diskrete Wahrscheinlichkeitsverteilungen und Schätzen ihrer Parameter,

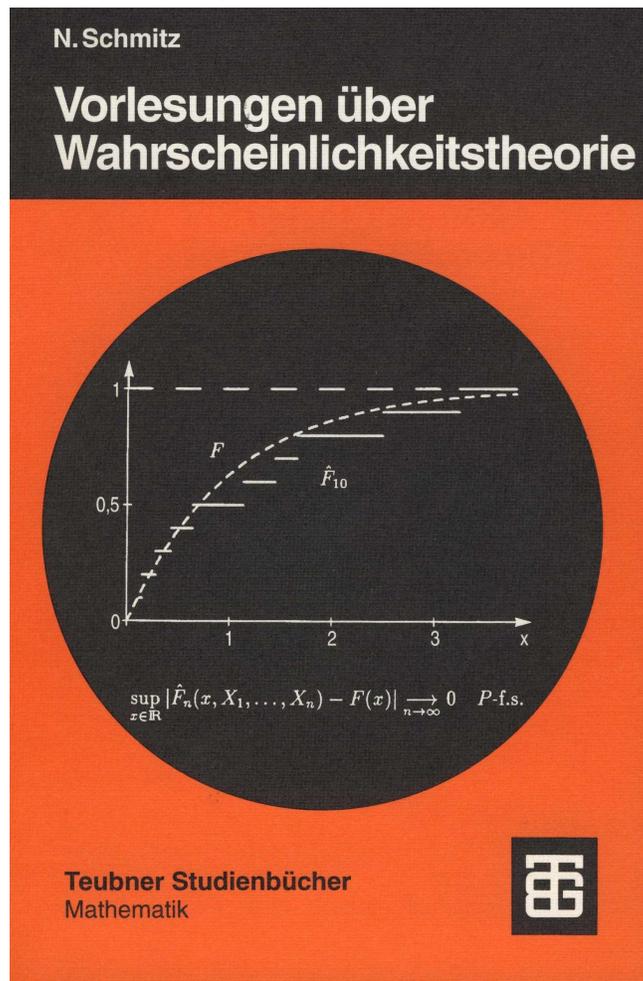
in dem er eine elementare Einführung in Grundbegriffe der Wahrscheinlichkeitsrechnung und Statistik (Stochastik) unter Verzicht auf maßtheoretische Hilfsmittel gab.



Zur Abrundung des Mathematik-Programms des Teubner-Verlags Stuttgart, in dem u. a. die umfangreichen Monographien von H. Witting und H. Witting/U. Müller-Funk zur Mathematischen Statistik erschienen waren, das jedoch kein Lehrbuch zur Wahrscheinlichkeitstheorie enthielt, wurden die vorher in Skript-Form erschienenen

Vorlesungen über Wahrscheinlichkeitstheorie

des Ref. als Teubner Studienbuch herausgegeben.



Das

2. Kiel-Münster-Kolloquium “Mathematische Stochastik”

fand am 29./30.06.1996 in Kiel statt. Das Programm

G. Alsmeyer: Markoffsche Erneuerungstheorie,

U. Rösler: Eine Fixpunktgleichung,

R. Urban: Shuffling on Groups,

M. Holst: Das asymptotische Risiko beim k -nächsten Nachbarn-Verfahren,

C. Schmidt: Lottovariationen,

M. Brake: Integralgleichungen für die verallgemeinerten Charakteristiken bei SPPRT's,

V. Paulsen: Die amerikanische Put-Option im Binomialmodell,

A. Irle: Zur Exzeßbeschränkung bei konkaven Stoppgrenzen,

V. Hoefs: Ein stetiges Pollingsystem,

N. Schmitz: Das modifizierte Kiefer-Weiss-Problem bei Exponentialfamilien,

war wiederum so interessant, dass eine Fortsetzung für das nächste Jahr geplant wurde.



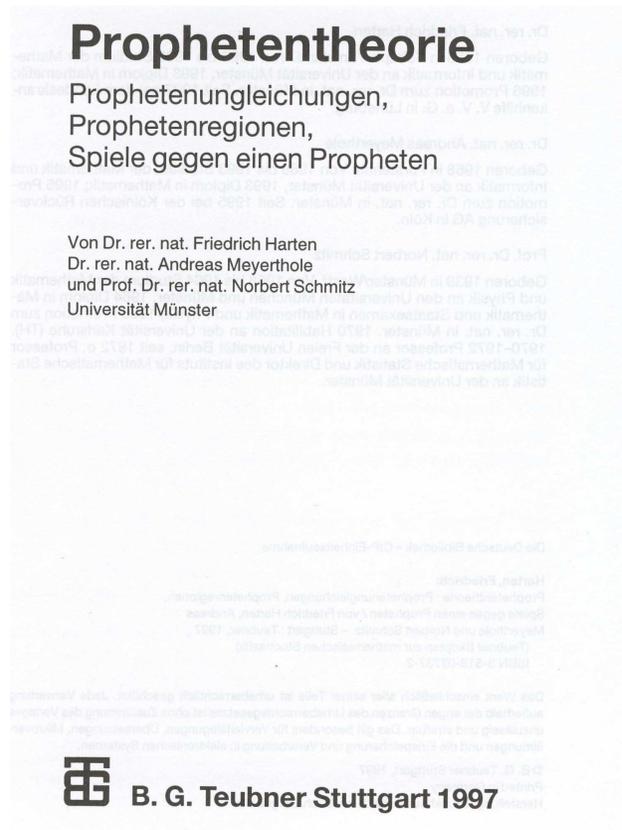
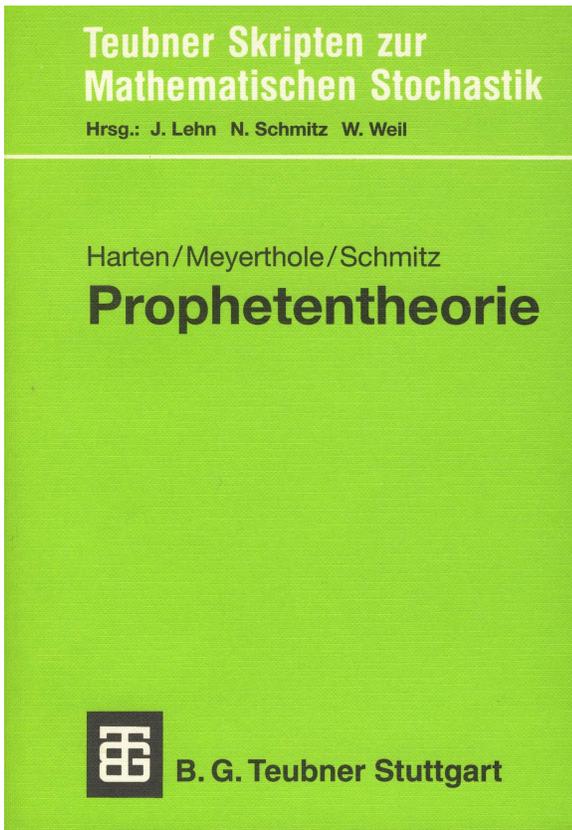
Die Teilnehmer am 2. Kiel-Münster-Kolloquium
M. Holst, A. Caliebe, V. Paulsen, R. Urban, V. Hoefs, C. Schmidt, V. Bruhn
F. Harten, M. Brake, G. Alsmeyer, N. Schmitz, M. Müller, U. Rösler, A. Irle

Mit der Promotion von Friedrich Harten war das Projekt “Prophetentheorie” des Ref. zu einem vorläufigen Abschluss gekommen (ab 2001 wurde es von Holger Kösters noch einmal intensiv aufgegriffen); “alle” bis dahin vorliegenden Ergebnisse dieses neuen Teilgebiets der Theorie des optimalen Stoppens wurden in dem 1997 erschienenen Band

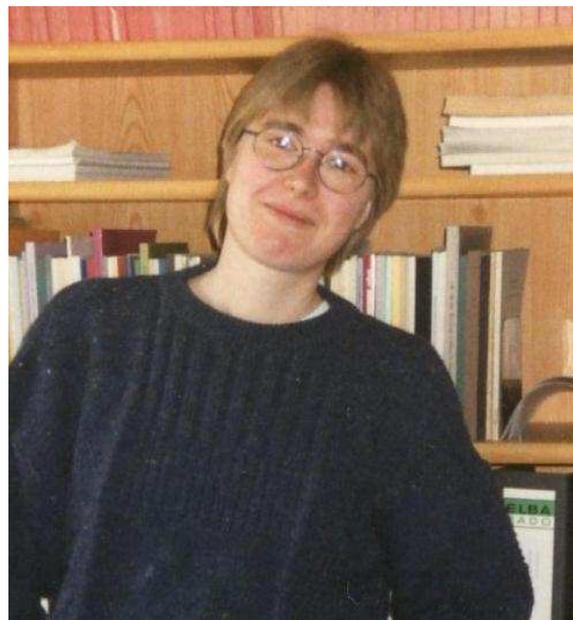
F. Harten/A. Meyerthole/N. Schmitz: Prophetentheorie

der “Teubner Skripten zur Mathematischen Stochastik” des Teubner-Verlags Stuttgart dargestellt¹⁰³).

¹⁰³Einem der “Väter” dieser Theorie, Prof. Dr. Ulrich Krengel (Göttingen), konnte pünktlich zu seinem 60. Geburtstag ein Exemplar dieses Teubner-Skripts übergeben werden.



Auch 1997 gab es wieder einige personelle Veränderungen bei den wissenschaftlichen Mitarbeitern: Frau Dipl.-Math. Annemarie Hawix wurde zunächst vom 01.01.1997 bis zum 31.03.1997 in der Arbeitsgruppe “Sequentielle Entscheidungsverfahren” des Ref., dann vom 01.04.1997 bis zum 30.09.1997 im Rahmen des DFG-Projekts Schm 677/6-1 “Das modifizierte Kiefer-Weiss-Problem” als Wissenschaftliche Mitarbeiterin eingestellt;



Dipl.-Math. Annemarie Hawix

zum 01.10.1997 wechselte sie zu einer Versicherungsgruppe. Ab dem 01.04.1997 wurde Herr Dipl.-Math. Thomas Teepe als Wissenschaftlicher Mitarbeiter im Rahmen der Arbeitsgruppe “Genetische Algorithmen” des Ref. eingestellt. Zum 31.12.1997 schied Dr. Jürgen Hille auf eigenen Wunsch aus dem Institut aus.

1997 erschienen u. a. die folgenden Publikationen:

G. Alsmeyer: The Markov renewal theorem and related results. *Markov Proc. Rel. Fields* 3 (1997), 103 – 127

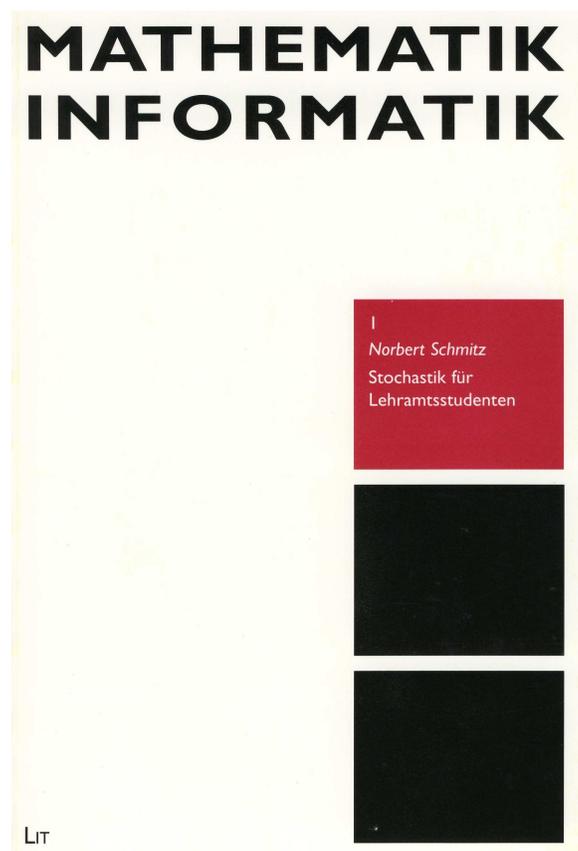
D. Plachky: Characterization of extremal extensions of measures restricted by majorization with application to decomposition of measures. *Atti Sem. Mat. Fis. Univ. Modena XLV* (1997), 235 – 246

— (gem. mit A. L. Rukhin): On the multiplicative structure of sufficient and complete sub-algebras in connection with products of statistical experiments. *Proc. 16th Intern. Conf. Multivariate Statist. Analysis 1997*, 117 – 128

Außerdem wurden die vorher als Band 21 der “Skripten zur Mathematischen Statistik” herausgegebenen “Vorlesungen über Stochastik” des Ref. in erheblich überarbeiteter Fassung unter dem Titel

“Stochastik für Lehramtsstudenten”

als Band 1 der Reihe Mathematik/Informatik des LIT-Verlags (Münster) publiziert.



Die fruchtbare Kooperation mit den Kieler Stochastikern konnte fortgesetzt werden; das

3. Kiel-Münster-Kolloquium “Mathematische Stochastik”

fand vom 05. bis zum 07. Juli 1997 in Münster statt.

Das Programm

U. Rösler: Orlicz-Normen für Maße,

V. Paulsen: Amerikanische Optionen,

J. Saß: Ein No-Arbitrage-Theorem,

A. Caliebe: Ein χ^2 -Test für Patch-Clamp-Daten mit verschiedenen Leitfähigkeitsstufen,

A. Hawix: Ein sequentielles Neyman-Pearson-Problem,

Th. Teepe: Zur Konvergenz genetischer Algorithmen,

M. Müller: Das Björk-Grandell-Modell: Ein Markov-Erneuerungsansatz,

V. Hoefs: Erneuerungsprozesse mit m -abhängigen Zuwächsen,

G. Alsmeyer: Rekurrenz von Markov-Random-Walks ohne Drift,

gab wiederum einen guten Einblick in die Aktivitäten der beteiligten Arbeitsgruppen.



Die Teilnehmer am 3. Kiel-Münster-Kolloquium

A. Hirsch, A. Hawix, V. Hoefs, V. Paulsen, J. Saß, U. Rösler, A. Caliebe, W. Thomsen,
G. Alsmeyer, Th. Teepe, A. Rukhin, M. Müller, A. Irlé (Foto N. Schmitz)

Einen besonderen Höhepunkt stellte das am 10./11.10.1997 wieder im Rahmen eines “Kompakt-Seminars für Diplom-Mathematiker” durchgeführte

5. Alumni-Treffen

dar. Das Programm:

Prof. Dr. A. Irle (Universität Kiel):

“Stochastische Methoden zur Bewertung von Finanzderivaten”

Dr. V. Firchau (Bayerische Landesbank München):

“Kursprognosen für Wertpapiere”

Dr. A. Meyerthole (Kölnische Rückversicherung):

“Tarifizierung, Scoring und Datenpooling in der Kraftfahrtversicherung”

Dipl.-Math. B. Kiese (Novartis, Basel):

“Biometrische Aspekte bei der Entwicklung neuer Tumorthérapien”

Dr. J. Gebhard (MGM Media Gruppe München):

“Online-Vermarktung von TV-Werbezeiten”

Dr. S. Bergs (Elektrisola):

“EDV/ORG in einem internationalen mittelständischen Unternehmen”

Dipl.-Math. W. Rentmeister (Andersen Consulting):

“Internet – Technologie und Trends”

Dipl.-Math. U. Lenz (Tandem Computers GmbH):

“Server-Net”

Dipl.-Math. A. Neimanis (SIS Deutschland):

“Offshore Development von Software”

Dr. M. Semmler (Quelle Schickedanz AG & Co):

“Über Anwendungen von Data-Mining-Methoden in einem Dataware House”

zeigte erneut, wie breit gefächert und interessant die Arbeitsbereiche von Mathematiker/innen sind. Ein nachträgliches “Highlight” des Vortrags von Prof. Irle war dabei, dass vier Tage nach seinem Vortrag bekannt wurde, dass der Nobelpreis für Wirtschaftswissenschaften 1997 an M. Scholes und R. Morton für die Theorie der Bewertung von Finanzderivaten vergeben worden ist.



Alumni-Treffen 1997

Im Jahre 1998 wurde Matthias Brake (am 21.12.) mit der Dissertation “Verfahren zur Berechnung von Charakteristiken sequentieller Tests” zum Dr. rer. nat. promoviert;



Dr. Matthias Brake

er wechselte dann zum 01.01.1999 zu einer Versicherungsgruppe. Zum 01.07.1998 ging Mathias Müller zu einem Software-Unternehmen; Volker Hoefs wechselte am 01.06.1998

von dem DFG-Projekt AL 448/1-1 auf eine Institutsstelle.

Ab dem 01.09.1998 wurde Herr Dipl.-Math. Jürgen Roters und ab dem 01.10.1998 Frau Dipl.-Math. Constanze Pumplün als Wissenschaftliche Mitarbeiter im Rahmen der Arbeitsgruppe “Maßtheoretische und entscheidungstheoretisch orientierte Statistik” von Prof. Plachky eingestellt.

An Veröffentlichungen erschienen 1998 insbesondere:

- D. Plachky: Characterization of discreteness of measures by a property of unique extension. Tatra Mt. Math. Publ. 14 (1998), 57 – 62
- N. Schmitz (gem. mit J. Gebhardt): Permutation tests – A revival?! Part I: Optimum properties. Statist. Papers 39 (1998), 75 – 85
- : Permutation tests – A revival?! Part II: An efficient algorithm for computing the critical region. Statist. Papers 39 (1998), 87 – 96
- N. Schmitz (gem. mit A. Hawix): Remarks on the modified Kiefer-Weiss-problem for exponential families. Sequential Anal. 17 (1998), 297 – 303
- : Stochastik für Lehramtskandidaten. LIT-Verlag, Münster, 2. Aufl. 1998

Die sehr erfreuliche Kooperation im Rahmen des

Kiel-Münster-Kolloquiums “Mathematische Stochastik”

konnte fortgesetzt werden; das 4. Treffen fand am 11./12.07.1998 in Kiel statt mit dem Vortragsprogramm:

- M. Brake: Gruppensequentielle Tests,
Th. Teepe: Genetische Algorithmen,
U. Dreses: Markoff-Erneuerungsmodell in der KFZ-Versicherung,
R. Pletziger: Bedienungssystem mit Markoff-modulierten Bedienzeiten,
A. Falahati: Two-Sex Galton-Watson Branching Process,
U. Rösler: Weighted Branching Process,
C. Schmidt: Asymptotisches Risiko von Editing-Verfahren,
V. Paulsen: Option Pricing.

Bei Prof. Alsmeyer “wuchs” in dieser Zeit ein besonders interessierter und leistungsstarker Diplomandenjahrgang heran. Die Ansätze zu eigenständigen wissenschaftlichen Leistungen waren so vielversprechend, dass sich Prof. Alsmeyer bereits fragte, wie man entsprechende Promotionsmöglichkeiten bereitstellen könnte. Gleichzeitig waren – nicht zuletzt aufgrund der stürmischen Entwicklung auf den Finanzmärkten – die Arbeitsmöglichkeiten für Mathematiker/innen hervorragend. Im Foyer des Mathematik-Hochhauses gab es Informationskampagnen von Personalvermittlern, und von Firmen wurden “Kopfgelder” für Mathematiker/innen geboten. In Praktika hatten sich die Diplomanden/innen von Prof. Alsmeyer über die Arbeitsmöglichkeiten informiert. Und so entschieden sich sukzessive

alle Diplomanden/innen dieses Jahrgangs, unmittelbar nach dem Examen zu Unternehmen (vor allem aus der Finanzbranche) zu wechseln; die Verträge hatten sie z. T. schon etliche Wochen vor der Aushändigung ihres Diploms unterschrieben. So erfreulich es auch war, dass die Studierenden von den Firmen so dringend benötigt wurden und die Absolventen/innen ihre attraktiven Chancen so gut nutzten, so enttäuschend war es natürlich, dass die “Saat” der wissenschaftlichen Anregungen nicht weiter wachsen konnte.

So gravierend der absurde kw-Vermerk NOK 87 an den beiden C4-Professuren (Plachky und Schmitz) für das Institut auch war, so hatte er zunächst (abgesehen von der de facto-Sperre für auswärtige Berufungen der beiden Betroffenen) keine unmittelbaren Auswirkungen auf das Lehr- und Forschungsprogramm – der Zeithorizont für die Realisierung lag noch deutlich später als die mittleren Zeitintervalle zwischen Novellierungen von Hochschulgesetzen u. ä. Inzwischen rückte der erste Emeritierungstermin (von Prof. Plachky im Frühjahr 2003) jedoch so nahe, dass bereits die mittelfristigen Planungen des Vorlesungsprogramms betroffen waren: Bei Wegfall dieser Professur würde sich das auf 5 Semester angelegte Programm, mit dem die Studierenden die Basis für ihre Abschlussarbeiten erhielten, nicht länger sicherstellen lassen – einzelne Jahrgänge würden erst mit einem Jahr Verzögerung zum Examen gelangen können.

In dieser Situation gab es nun eine überraschende neue Entwicklung: Am 20.01.1999 teilte die Ministerin für Schule und Weiterbildung, Wissenschaft und Forschung des Landes NRW, Frau G. Behler, in einer Pressemitteilung mit, sie beabsichtige, mit den Hochschulen einen “Qualitätspakt” abzuschließen, der vorsehe, “dass die Hochschulen über einen Zeitraum von zehn Jahren rund 2.000 ihrer etwa 60.000 Stellen abbauen.” In späteren Passagen der Pressemitteilung wurde versprochen, “im Gegenzug sollen die Hochschulen mehr Planungssicherheit erhalten ...”. Im Rechenschaftsbericht des Rektorates der WWU über das Jahr 1999 heißt es dazu: “ Das wohl prägende hochschulpolitische Ereignis des Jahres 1999 war zweifellos der zwischen der Regierung und den Hochschulen des Landes geschlossene “Qualitätspakt”. Darüber, dass die Bezeichnung Qualitätspakt eher als Etikettenschwindel gelten muss, bestand nicht nur in der Universität Münster, sondern auch zwischen allen Hochschulen des Landes Einvernehmen. Dennoch hat sich der Senat der Universität Münster in seiner Sitzung am 21.04.1999 für eine Beteiligung am Qualitätspakt ausgesprochen, da die vom Land vorgeschlagene Alternative die Universität in ihrem Personal- und Sachmittelhaushalt noch schlechter gestellt hätte.” Es erstaunt nicht, dass sich für dieses Abkommen schnell die Bezeichnung “Qual-Pakt” fand.

Für die Verteilung der 183 von der WWU abzugebenden Stellen auf die einzelnen Fächer setzte der Senat ebenfalls am 21.04.1999 eine Qualitätspakt-Kommission ein, für die sich nach ihrem Vorsitzenden die Bezeichnung “Ströbele-Kommission” einbürgerte. In diesem Gremium war der Fachbereich Mathematik und Informatik nicht vertreten. Das hatte u. a. zur Folge, dass grob falsche Daten, mit denen die Kommission argumentierte, vom Fachbereich nicht korrigiert werden konnten, seine Beteiligung an den Studiengängen Wirtschaftsinformatik und Geoinformatik unterschlagen wurde, die Bewilligung des SFB 478 “Geometrische Strukturen in der Mathematik” und die Einrichtung neuer Studiengänge nicht zur Kenntnis genommen und die Tatsache, dass am Fachbereich drei Leibniz-Preisträger wirkten, in keinerlei Weise gewürdigt wurde. Und so schlug die “Ströbele-Kommission” vor, der zu 115 % ausgelastete Fachbereich Mathematik und Informatik solle 9 Stellen abgeben.

Andererseits ergaben sich dadurch neue Aspekte, dass zwar die mit kw-Vermerk versehenen Stellen in die “Streichmasse” der Universität einbezogen wurden, jedoch sonst keine Einzelvorgaben für die zu streichenden Stellen gemacht wurden. Daraufhin stellten Prof. Alsmeyer und der Ref. am 15.07.1999 den ausführlich begründeten Antrag an den Fachbereich, diese Möglichkeit zu nutzen, um sich für eine Nachfolge Plachky einzusetzen; das Institut sei dann bereit, ein anderweitiges “Opfer” für den Fachbereich zu tragen.

Dieser Antrag wurde von einer Struktur-Arbeitsgruppe des Fachbereichs aufgegriffen und von den Professoren Dr. J. Cuntz, Dr. Chr. Deninger, Dr. P. Schneider – den drei am Fachbereich tätigen Leibniz-Preisträgern – in einem Gespräch mit dem Rektor und dem Kanzler der WWU am 21.10.1999 vorgetragen. Dabei wurde geklärt, dass die o. g. C4-Stelle fachbereichsintern mit einer anderen im Planungszeitraum frei werdenden C3- oder C4-Stelle ausgetauscht werden könnte, und es wurden positive Signale bezüglich Wiederzuweisungen anderer Stellen gegeben. Dank dieses außerordentlich erfreulichen Einsatzes der drei prominenten Direktoren des Mathematischen Instituts zeichnete sich somit trotz der insgesamt düsteren Stimmung für das Institut ein “Silberstreif am Horizont” ab.

Ungeachtet dieser z. T. hektischen Diskussionen und Aktivitäten konnte die Arbeit des Instituts auch 1999 erfolgreich fortgesetzt werden: Am 22.12.1999 wurde Volker Hoefs mit der Dissertation “Markov-Erneuerungstheorie für stationäre $(m + 1)$ -Block-Faktoren” zum Dr. rer. nat. promoviert; er wechselte zum 01.01.2000 zu einer norddeutschen Bank.



Dr. Volker Hoefs

Zum 01.10.1999 wurde Herr Dipl.-Math. Marcus Wrede als Wissenschaftlicher Mitarbeiter im Rahmen der Arbeitsgruppe “Finanzmathematik” des Ref. eingestellt.

Die Veröffentlichungsliste des Instituts für das Jahr 1999 umfasste u. a.:

- G. Alsmeyer (gem. mit A. Gut): Limit theorems for stopped functionals of Markov renewal processes. *Ann. Inst. Math. Statist.* 51 (1999), 369 – 382
— (gem. mit M. Sgibnev): On the tail behaviour of the supremum of a random walk defined on a Markov chain. *Yokohama Math. J.* 46 (1999), 139 – 159

- M. Brake: Verfahren zur Berechnung von Charakteristiken sequentieller Tests. Dissertation Münster 1998; erschienen als Band 31 der Skripten zur Mathematischen Statistik
- J. Hille; D. Plachky; J. Roters: Versions of conditional expectations depending continuously on parameters. *Math. Methods Statist.* 8 (1999), 99 – 108
- V. Hoefs: Markov-Erneuerungstheorie für stationäre $(m + 1)$ -Block-Faktoren. Dissertation Münster 1999; erschienen als Band 32 der Skripten zur Mathematischen Statistik
- D. Plachky: A version of the strong law of large numbers universal under mappings. *Math. Slovaca* 49 (1999), 229 – 233
- (gem. mit A. L. Rukhin): Nonparametric covariance estimation in multivariate distributions. *Metrika* 50 (1999), 131 – 136
- : Characterization of probability distributions by independence structures. *Math. Methods Statist.* 8 (1999), 90 – 105

Wenngleich es auch im Jahre 2000 wieder neue gravierende Einschnitte in die Universitätsstruktur gab – z. B. durch das neue Hochschulgesetz¹⁰⁴ und das Gesetz zur Errichtung des Bau- und Liegenschaftsbetriebs des Landes Nordrhein-Westfalen – so standen die auch für die Lebensfähigkeit des Instituts essentiellen Auswirkungen des Qualitätspaktes doch weiterhin im Zentrum des Interesses der WWU. Jetzt ging es um das Votum eines “Expertenrats”. Dieses von der Landesregierung Nordrhein-Westfalen eingerichtete Gremium von unabhängigen Experten sollte “das Studien- und Forschungsangebot der nordrhein-westfälischen Hochschulen einer ‘Querschnittsuntersuchung’ unterziehen und Empfehlungen zu ihrer inhaltlichen und strukturellen Entwicklung geben”. In der Praxis bedeutete dies, dass die für die WWU im Expertenrat zuständige Arbeitsgruppe Ostwestfalen gemeinsam mit Vertretern des Ministeriums zu “Visitationen” kam, am 31.07.2000 einen Zwischenbericht veröffentlichte und mit Schreiben vom 31.08.2000 der WWU einen “Sachstandsbericht” (d. h. eine Zusammenfassung des 1999 erstatteten Berichts) mit der Bitte um Durchsicht und ggf. Stellungnahme übersandte. Im Rechenschaftsberichts des Rektorats über das Jahr 2000 heißt es dazu: “Die Universität Münster konnte sich in ihrem Sachstandsbericht nur in Teilen wiederfinden, was insoweit nicht verwundert, als bei einer solch drastischen, für die Verwendung als Arbeitsgrundlage jedoch erforderlichen Kürzung des Berichts immer die Gefahr besteht, dass durch die Auswahl der übernommenen Fak-

¹⁰⁴Im Rechenschaftsbericht des Rektorats über das Jahr 2000 heißt es dazu u. a.: “Nachdem zwischenzeitlich Zweifel daran aufgetreten waren, ob es in der vorangegangenen Legislaturperiode des Landtags noch zur Verabschiedung des seit längerem geplanten Hochschulgesetzes kommen würde, ist das Gesetz über die Hochschulen des Landes Nordrhein-Westfalen doch noch zum 01.04.2000 in Kraft getreten. Das neue Hochschulgesetz bringt ... tiefgreifende Änderungen für die Universität mit sich. ... Die Universität Münster hat für die Umsetzung des Hochschulgesetzes in der Universitätsverfassung und den nachgeordneten Ordnungen zwei Jahre Zeit, danach – somit spätestens zum 01.04.2002 – gilt das Hochschulgesetz in der Universität Münster unmittelbar. Der Senat hat deshalb im Sommersemester 2000 eine Kommission zur Erarbeitung einer neuen Universitätsverfassung auf der Grundlage des Hochschulgesetzes eingesetzt, die sich noch im Sommersemester 2000 konstituiert und ihre Arbeit aufgenommen hat. Wegen der Vielzahl der vom Hochschulgesetz eingeräumten Gestaltungsmöglichkeiten werden – anders als bisher – die Fachbereiche, Einrichtungen sowie Funktionsträgerinnen und Funktionsträger frühzeitig in das Verfahren eingebunden, um die anstehenden Entscheidungen auf breiter Basis treffen zu können.”

ten Akzente gesetzt werden, die nicht in jedem Fall die gesamte Realität widerspiegeln oder sogar zu Verzerrungen führen. Die Universität hat deshalb einen in weiten Teilen geänderten Sachstandsbericht vorgelegt, der dem durch Zahlen und Fakten untermauerten Selbstbild der Universität entspricht." Die "Hängepartie" (oder der – wie in dem o. g. Bericht formuliert – "Schwebezustand") bei der zweiten C4-Professur am Institut ging also in das Jahr 2001.

Dennoch konnte die erfolgreiche Lehr- und Forschungsarbeit des Instituts auch im Jahre 2000 fortgesetzt werden: Zum 01.01.2000 wurde Herr Dipl.-Math. Jörg Konopka als Wissenschaftlicher Mitarbeiter im Rahmen der Arbeitsgruppe "Sequentielle Entscheidungsverfahren" des Ref. eingestellt. Prof. B. K. Ghosh (Lehigh University, Bethlehem, USA), der bereits 1986/87 und 1992 als Humboldt-Preisträger am Institut gewirkt hatte, war vom 19.09. bis zum 21.12.2000 als Gast am Institut.

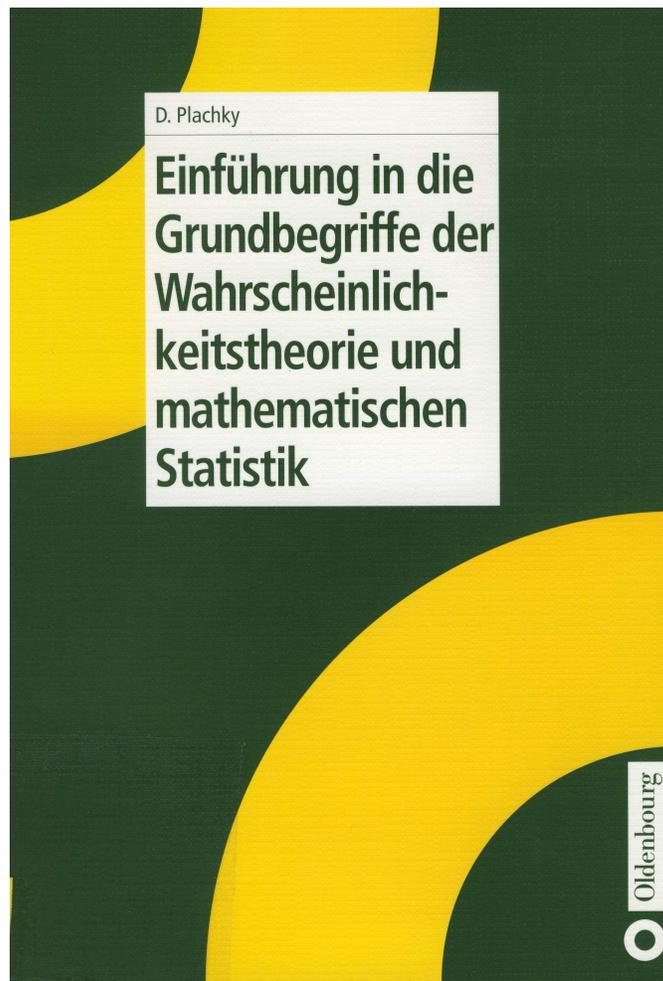
An Publikationen erschienen im Jahr 2000 insbesondere:

- G. Alsmeyer: The ladder variables of a Markov random walk. *Prob. Math. Statist.* 20 (2000), 151 – 168
- D. Plachky: Note on invariant and almost invariant measurable sets. *Tatra Mt. Math. Publ.* 19 (2000), 21 – 30
- : Extension of Measures with Applications to Probability and Statistics. Oldenbourg, München, 2000
- N. Schmitz (gem. mit A. Meyerthole): Games against a prophet for stochastic processes. In: *Game Theory, Optimal Stopping, Probability and Statistics* (Eds.: Th. Bruss, L. LeCam). *Inst. Math. Statistics Lecture Notes* 35 (2000), 53 – 69
- : Prophet inequality for the general S_n/n -problem. *Statist. Neerlandica* 54 (2000), 381 – 382

Eine maßtheoretisch fundierte

Einführung in die Grundbegriffe der Wahrscheinlichkeitstheorie
und mathematischen Statistik,

die auf seinen Vorlesungen basierte, publizierte Prof. Plachky im Oldenbourg-Verlag München.



Bereits zum fünften Mal wurde das Kiel-Münster-Kolloquium über “Mathematische Statistik” durchgeführt; diesmal wieder in Münster und zwar am 27./28. Mai 2000. Das Programm

A. Caliebe: Der Maximum-Likelihood-Pfadschätzer für Hidden-Markov-Modelle,
J. Saß: Optimales Portfolio-Management bei Transaktionskosten,
U. Rösler: Der Pascha-Prozeß,
J. Konopka: Ein sequentielles Neyman-Pearson-Lemma,
M. Wrede: Overhedging in unvollständigen Modellen,
G. Alsmeyer: Iterationen zufälliger Lipschitz-Funktionen,

gab einen guten Einblick in die Arbeitsgebiete; der Kolloquiumsvortrag von Dr. M. Löwe (Univ. Eindhoven, Niederlande) am 27.05.2000

“Konvergenzgeschwindigkeit von Markov-Chain Monte-Carlo-Methoden”

bildete eine willkommene Ergänzung.

Am 20.02.2001 schloss der Expertenrat seine Arbeit mit der Vorlage seines Gutachtens ab. Die WWU sah sich zwar durch die Bewertungen durchaus in ihrer Arbeit bestätigt,

war jedoch enttäuscht darüber, dass vom Expertenrat keinerlei neue Empfehlungen für die abzusetzenden Stellenkontingente gegeben wurden. Damit blieb es bei 183 bis 2009 abzuliefernden Stellen. Sinnvollerweise beschloss die WWU, zunächst nur die bis zum Jahr 2003 abzuliefernden Stellen festzulegen, um bei der für 2003 geplanten Benennung der weiteren Stellen eingetretene Veränderungen und neue Perspektiven berücksichtigen zu können. Überraschend traf jedoch im Oktober 2001 eine Aufforderung des Ministeriums für Schule, Wissenschaft und Forschung ein, das gesamte Kontingent kurzfristig stellenscharf zu benennen (und somit die Personalplanungen bis 2009 zu "zementieren"). Dieser Aufforderung musste sich die WWU mit der Vorlage einer entsprechenden Liste beugen.

Für die erste Tranche (bis 2003) schlug eine vom Fachbereich Mathematik und Informatik eingesetzte Strukturkommission u. a. vor,

- eine Sekretärinnenstelle aus dem Institut für Mathematische Statistik abzuziehen und für die Gewinnung einer Techniker-Stelle für das Institut für Informatik zu nutzen;
- eine Stelle eines wissenschaftlichen Mitarbeiters am Institut für Mathematische Statistik für die Streichung zu benennen;
- als Ersatz für die Zuweisung einer C4-Professur für Mathematische Stochastik (als Nachfolge für die Professur von Prof. Plachky) die erste der in 2004 freiwerdenden C3-Stellen am Mathematischen Institut für die Streichung zu benennen.

Diesen Vorschlag nahm der Fachbereichsrat auf. Dank der Weitsicht des Fachbereichs, insbesondere des Mathematischen Instituts, erschien damit eine erfolgreiche Zukunft des Instituts für Mathematische Statistik wieder im Bereich des Möglichen.

Daraufhin wandten sich Prof. Alsmeyer und der Ref. am 18.12.2000 in einem ausführlich begründeten Schreiben an den Dekan, wobei sie ausführten: "Mit Ablauf des Wintersemesters 2002/2003 wird Herr Prof. Dr. Plachky emeritiert werden. In Anbetracht dessen, daß

- einerseits (gemäß §48 HG) bis spätestens zum Ende des Sommersemesters 2002 ein Berufungsvorschlag des Fachbereichs vorgelegt werden muss und die Erarbeitung eines solchen Vorschlags in der Regel (mindestens) zwei Semester erfordert und
- andererseits im Hinblick auf die zum Ablauf des Sommersemesters 2004 erfolgende weitere Emeritierung (Prof. Dr. Schmitz) eine möglichst frühzeitige Besetzung der o. g. Professur erreicht und der neuen Kollegin/dem neuen Kollegen eine intensive Mitwirkung ermöglicht werden sollte,

bitten wir, noch in diesem Wintersemester den Wiederzuweisungsantrag für die Professur von Herrn Prof. Dr. Plachky zu beraten und gegebenenfalls zu stellen.

Wir empfehlen, die Professur mit der Ausrichtung

Professur für Mathematische Stochastik

wiederzubeantragen." In seiner Sitzung am 31.01.2001 beschloss der Fachbereichsrat dann einstimmig, den Wiederzuweisungsantrag in der vorgeschlagenen Form zu stellen. Nach

der Beschaffung von umfangreichem Datenmaterial, das einem solchen Antrag beigelegt werden musste (u. a. 24-seitige Angaben zum Strukturplan des Fachbereichs mit von den Dezernaten 1.3, 3/6.3 und 4.1 gelieferten Daten), konnte der Dekan Prof. Dr. Peter Schneider am 24.04.2001 den Wiederzuweisungsantrag stellen.

Das Rektorat der Westfälischen Wilhelms-Universität beriet in seiner Sitzung am 19.07.2001 über diesen Antrag und stimmte der Wiederzuweisung zum Freiwerden der Stelle am 01.03.2003 zu. Als Ausschreibungsfrist wurde der 31.10.2001 festgesetzt.

Damit war eine existenzbedrohende Phase für das Institut zu einem positiven Abschluss gelangt; trotz der personellen Einbußen eröffneten sich Perspektiven für eine erfolgreiche künftige Arbeit (mit neuen Forschungsrichtungen und veränderten Akzenten).

Nicht zuletzt aufgrund der Unsicherheiten über die zukünftigen Entwicklungen hatte sich Frau Martina Forstmann umorientiert: Nach mehr als 14-jähriger erfolgreicher Tätigkeit als Institutssekretärin wechselte sie zum 01.11.2001 an das Institut für Neutestamentliche Textforschung; im Rahmen des 6. Alumni-Treffens wurde sie am 03.11.2001 mit herzlichem Dank für ihr engagiertes Wirken verabschiedet. Ab dem 01.11.2001 war Frau Anita Kollwitz für die Sekretariatsaufgaben des gesamten Instituts zuständig.



Martina Forstmann

Zum 01.10.2001 wechselte Thomas Teepe als Wissenschaftlicher Mitarbeiter von der Institutsstelle für die Zeit bis zum 31.12.2001 auf eine Stelle im Rahmen des DFG-Projekts Schm 677/7 "Prämienneukalkulation bei Kostensteigerungen". Am 05.12.2001 wurde er mit der Dissertation "Ersteintrittszeiten genetischer Algorithmen" zum Dr. rer. nat. promoviert; 2002 ging er zu einer Firma in Stuttgart.



Dr. Thomas Teepe

Zum sechsten Male wurde das Kiel-Münster-Kolloquium “Mathematische Stochastik” durchgeführt; diesmal vom 27. bis zum 29. April 2001 im Rahmen des Baltic III Workshop

“Branching Processes and Sequential Procedures”

in Kiel. Aus Münster nahmen an diesem Workshop mit Vorträgen teil:

G. Alsmeyer: Palm duality and branching in random environment,

J. Konopka: Redundant observations with applications to sequential testing,

M. Wrede: Variations of the Cox-Ross-Rubinstein model,

sowie M. Jaeger, D. Kuhlbusch, N. Schmitz und Th. Teepe. Vorträge von I. Afanasyev (Moskau), A. Caliebe (Kiel), Dyakonova (Moskau), J. Geiger (Frankfurt), A. Irle (Kiel), G. Kersting (Frankfurt), S. Klovov (Omsk), R. Lerche (Freiburg), V. Lotov (Novosibirsk), V. Paulsen (Kiel), U. Rösler (Kiel), N. Tchernova (Novosibirsk), A. Topchij (Moskau). V. Topchij (Omsk), V. Valutin (Moskau) boten eine Fülle von Informationen zu den o. g. Themen.

Ebenfalls zum sechsten Mal fand ein

Alumni-Treffen

im Rahmen eines “Kompakt-Seminars für Diplom-Mathematiker” statt. Am 03./04. November 2001 nahmen über 100 “Ehemalige” an diesem Treffen teil. Die Vorträge

Prof. Dr. G. Alsmeyer (Institut für Mathematische Statistik der WWU):

“Von zufälligen Fraktalen und Bäumen zu Algorithmen – eine überraschende Verbindung”

- Dipl.-Math. D. Feidieker (Deutsche Börse AG Frankfurt):
 “StatistiX – Aufbau eines Data Warehouses im Bereich Information Products”
- Dipl.-Math. B. Scheffler (Roche Diagnostics GmbH Mannheim):
 “Entwicklung und Kalibration diagnostischer Tests”
- Dipl.-Math. R. Gratzfeld (Henkel KG Düsseldorf):
 “Business Intelligence in der Henkel-Gruppe”
- Dipl.-Math. A. Hinterding (Institut für Geoinformatik der WWU):
 “Statistische Verfahren in der raumbezogenen Datenverarbeitung”
- Dipl.-Math. R. Pletziger (Kölnische Rückversicherung/General CologneRe):
 “Kraftfahrt-Benchmark: Ein Gemeinschaftsprojekt für mehr Transparenz
 im deutschen ‘Tarifdschungel’ ”
- Dipl.-Math. J. te Vrugt (Philips Forschungslabor Aachen):
 “Eine natürliche Modalität für Benutzerschnittstellen: Sprache”
- Dr. E. Wallmeier (Siemens AG München):
 “Mobile Netze der dritten Generation auf GMS Basis”
- Dipl.-Math. Chr. Bröring (Oldenburgische Landesbank/Allianz Dresdner Konzern):
 “Kundenkalkulation bei der Oldenburgischen Landesbank (OLB) – Welches
 Marktergebnis erzielt ein OLB-Kunde?”

boten wieder einen breiten und anregenden Überblick über die vielfältigen Tätigkeitsfelder von Mathematikern, von dem auch die aktuellen Diplomanden/innen profitieren konnten.

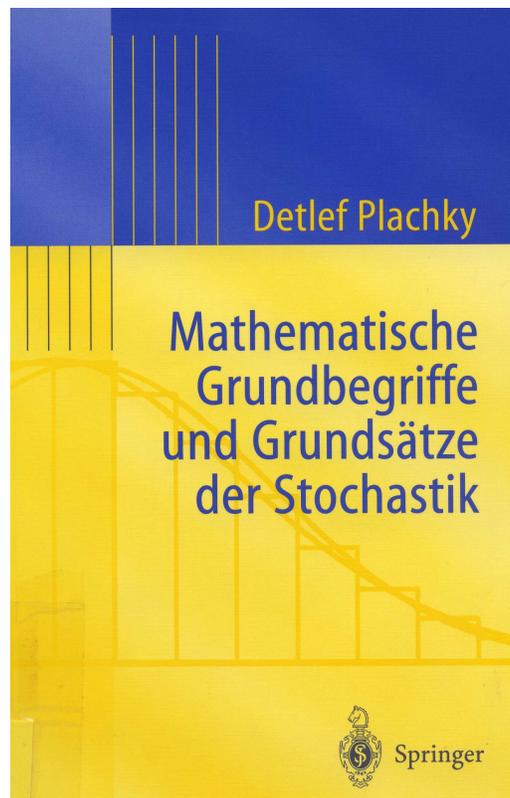


6. Alumni-Treffen

An Publikationen erschienen 2001 u. a.:

- G. Alsmeyer: Recurrence theorems for Markov random walks. *Probab. Math. Statist.* 21 (2001), 123 – 134
- : Two comparison theorems for nonlinear first passage times and their linear counterparts. *Statist. Probab. Lett.* 55 (2001), 163 – 171
- (gem. mit V. Hoefs): Markov renewal theory for stationary m -block factors. *Markov Proc. Appl.* 98 (2001), 77 – 112
- (gem. mit C. D. Fuh): Limit theorems for iterated random functions by regenerative methods. *Stochastic Process. Appl.* 96 (2001), 123 – 142; *Corr.* 97 (2002), 341 – 345
- D. Plachky: An ideal theoretic characterization of finite sets, finite algebras, and σ -algebras of countably generated type. *Math. Slovaca* 61 (2001), 301 – 311
- : Sufficiency and completeness for classes of probability distributions generated by a single probability distribution. *Abh. Math. Sem. Univ. Hamburg* 71 (2001), 305 – 308
- N. Schmitz: SLLN for identically distributed random variables – a conjecture. *Statist. Papers* 42 (2001), 535 – 536
- M. Wrede; N. Schmitz: Variations of the Cox-Ross-Rubinstein model – conservative pricing strategies. *Math. Meth. Oper. Research* 53 (2001), 505 – 515

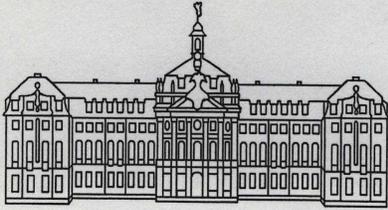
Außerdem publizierte Prof. Plachky im Springer-Verlag eine aus Veranstaltungen für



Abiturienten zur Vorinformation über das Studium der Mathematik entstandene Einführung in mathematische Grundbegriffe und Prinzipien der Stochastik.

Das Jahr 2002 war für den Fachbereich Mathematik und Informatik zunächst belastet durch die äußerst unerfreuliche Verpflichtung, die Stellenstreichungen der 2. Tranche (2004 – 2009) mit den Strukturplanungen in Einklang zu bringen. Diese Aufgabe wurde dadurch erleichtert, dass die Kommission für Struktur, Planung und Bauangelegenheiten (KSPB) der WWU in ihrer Sitzung am 12.11.2001 aufgrund der inzwischen dokumentierten (und zur Kenntnis genommenen) Leistungen des Fachbereichs vorgeschlagen hatte, bis 2009 anstelle der ursprünglich 9 Stellen nur 7 Stellen abzuziehen, und dass sich das Rektorat trotz eines gegenteiligen Votums des Senats vom 22.11.2001 an diesen Vorschlag (und vorherige Zusagen) gehalten hatte.

Auf das Institut für Mathematische Statistik kam die Aufgabe zu, an dem Berufungsverfahren für die C4-Stelle mitzuwirken, die mit dem folgenden Text ausgeschrieben worden war:



**Westfälische
Wilhelms-Universität
Münster**

Am Fachbereich Mathematik und Informatik ist zum Sommersemester 2003 eine

C4-Professur für Mathematische Stochastik

zu besetzen.

Der/Die zukünftige Stelleninhaber(-in) hat das Fach in Forschung und Lehre in voller Breite zu vertreten. Er/Sie soll einen Schwerpunkt im Bereich der Mathematischen Stochastik vertreten (Stochastische Prozesse, Mathematische Statistik, Stochastische Analysis, Finanzmathematik, Stochastische Algorithmen, Computational Statistics, o. ä.), Lehrveranstaltungen aus dem Gesamtgebiet der Mathematischen Stochastik abhalten und sich an den Grundvorlesungen im Fachbereich und der mathematischen Betreuung Studierender anderer Fachbereiche angemessen beteiligen.

Die Westfälische Wilhelms-Universität will eine Erhöhung des Frauenanteils dort erreichen, wo Frauen unterrepräsentiert sind, und fordert deshalb besonders Frauen auf, sich zu bewerben.

Schwerbehinderte werden bei gleicher Qualifikation bevorzugt.

Bewerbungen mit den üblichen Unterlagen (Lebenslauf, Schriftenverzeichnis, Angabe über die bisherige Lehrtätigkeit) sind bis zum 31.10.2001 zu richten an:

Dekan des Fachbereichs Mathematik und Informatik
Westfälische Wilhelms-Universität
Einsteinstr. 62

D - 48149 Münster

Prof. Plachky hatte ausdrücklich gewünscht, dass im Ausschreibungstext nicht von seiner Nachfolge gesprochen wurde.

Auf diese Ausschreibung gingen 66 Bewerbungen ein, die einer breiten Palette von mathematisch-stochastischen Fachrichtungen entstammten. Unter dem Vorsitz von Prof. Dr. Helmut Maurer beschloss die Kommission nach längeren, eingehenden Diskussionen, acht dieser Bewerber/innen in die engere Auswahl zu nehmen und zu Vorträgen einzuladen. Diese (öffentlichen) Vorstellungsvorträge mit anschließenden Diskussionen, Befragungen durch die Kommission und abschließenden Nachsitzungen fanden bereits im Dezember 2001 und im Januar 2002 statt. Auf ihrer Sitzung am 01.02.2002 beschloss die Kommission dann einstimmig, die Bewerbungen von fünf Bewerbern weiterzuverfolgen und zu diesen vergleichende Stellungnahmen auswärtiger Gutachter einzuholen. Noch in der Zeit bis zur nächsten Sitzung der Kommission am 26.04.2002 hatte allerdings einer dieser Kandidaten einen Ruf auf eine C4-Professur an einer anderen Universität erhalten und sogar bereits angenommen. Am 29.05.2002 verabschiedete die Kommission dann einstimmig eine Berufungsliste. Diese Liste wurde vom Fachbereichsrat in seiner Sitzung am 05.06.2002 ebenfalls einstimmig verabschiedet und dem Rektorat vorgelegt. Damit waren vom Fachbereich Mathematik und Informatik zügig die Weichen für eine Wiederbesetzung der C4-Professur von Prof. Plachky gestellt. Der Senat der WWU billigte diese Liste auf seiner Sitzung am 17.07.2002 wiederum einstimmig.

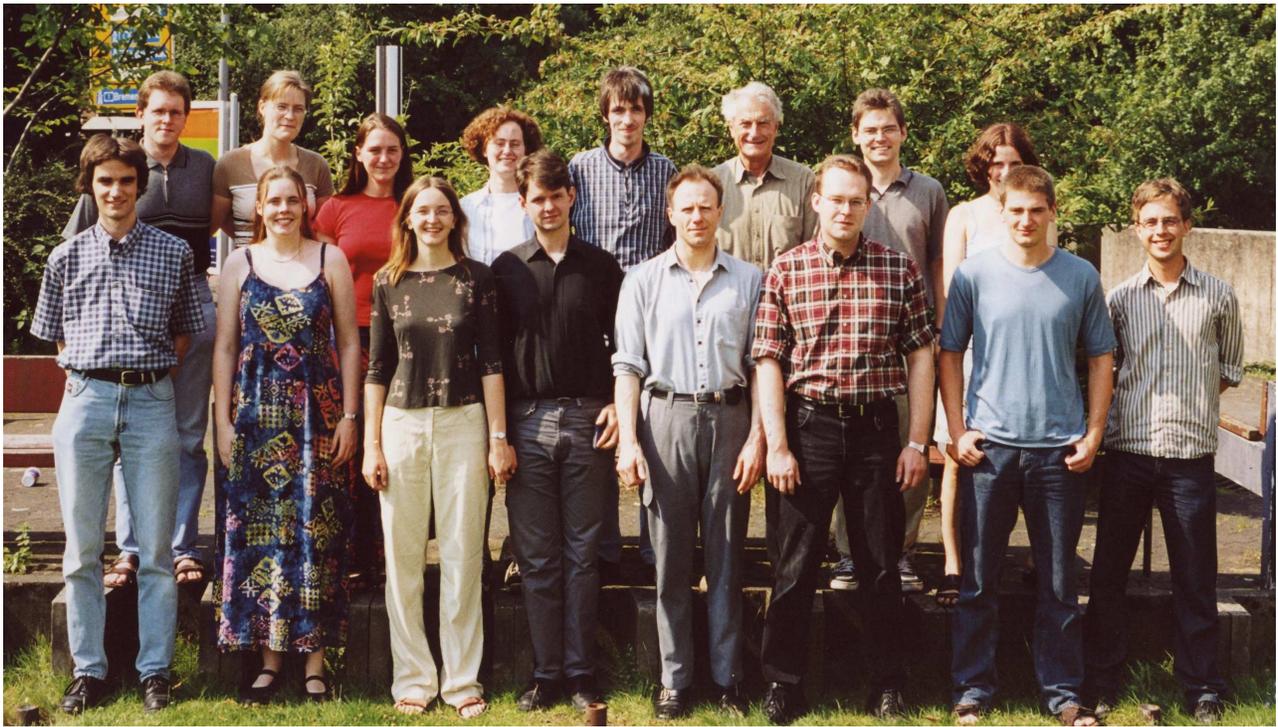
Natürlich ging die Arbeit am Institut währenddessen – zum Teil mit neuem Elan – weiter: So konnten die Herren Dipl.-Math. Dirk Kuhlbusch (ab dem 01.01.2002) und Dipl.-Math. Markus Jaeger (ab dem 01.10.2002) als Wissenschaftliche Mitarbeiter in der Arbeitsgruppe von Prof. Alsmeyer eingestellt werden; Markus Jaeger hatte vorher (vom 01.05. bis 30.09.2002) als Wiss. Mitarbeiter im Rahmen des DFG-Projekts Schm 677/7 “Prämienneukalkulation bei Kostensteigerungen” mitgewirkt. Ab dem 01.08.2002 arbeitete Herr Dipl.-Math. Dominik Völker im Rahmen eines Promotionsstipendiums der WWU in der Arbeitsgruppe “Permutationstests”; ab dem 01.10.2002 konnte Herr Dipl.-Math. Holger Kösters im Rahmen des DFG-Projekts Schm 677/8 “Theorie des optimalen Mehrfachstoppens; Prophetenungleichungen bei Mehrfachstoppen” des Ref. eingestellt werden.

In den vorherigen Semestern war beim Ref. ein besonders leistungsstarker und eng kooperierender Diplomanden-Jahrgang herangewachsen; die Studierenden schafften es durch fruchtbare Zusammenarbeit, dass alle – auch einige, die in anderen Instituten ihre Arbeit schrieben – im Ausbildungs“takt” blieben. Als nun die ersten Diplome anstanden, hatten Bianca Allendorf und Robert Wilken die Idee, ein gemeinsames Abschiedsfest zu feiern und dabei ein Heft

Mein Semester: 1997 – 2002

zu erstellen, in dem alle Beteiligten ihre liebsten Freizeitbeschäftigungen, ihre mathematischen Lieblinge u.a.m. “offenbaren” – eine schöne Erinnerung an eine prägende Zeit (siehe auch S. 244).¹⁰⁵

¹⁰⁵Wie leistungsstark dieser Jahrgang und seine Betreuer waren, wird daran deutlich, dass H. Kösters, J. Konopka, D. Völker und M. Wrede beim Ref. zum Dr. rer. nat. promoviert wurden, H. Kläver in Köln, I. Kühn und B. Wilken in Münster zum Dr. rer. pol. promoviert wurden und B. Allendorf als Fulbright-Stipendiatin nach Kalifornien ging.



Der DiplomandInnen-Jahrgang 2002/03 mit Betreuern
Obere Reihe: Dipl.-Math. Marcus Wrede, Irmhild Kühn, Jana Bergfeld, Kathrin Wermes,
Arne Scheffer, Ref., Hendrik Kläver, Bianca Allendorf
Vordere Reihe: Holger Kösters, Stephanie Rath, Karin Pohlkamp, Henrik Buchholz,
Dipl.-Math. Jörg Konopka, Georg Schlüter, Dominik Völker, Robert Wilken



Die inzwischen zur guten Tradition gewordene Zusammenarbeit mit dem Kieler Stochastikern wurde mit dem

7. Kiel-Münster-Kolloquium "Mathematische Stochastik"

am 12. und 13.10.2002 in Münster fortgeführt.



Die Teilnehmer am 7. Kiel-Münster-Kolloquium
Obere Reihen: M. Wendt, L. Willert, H. Kösters, J. Konopka, W. Thomsen,
D. Kuhlbusch, D. Völker, M. Jaeger, N. Schmitz
Vordere Reihe: D. Knof, M. Rizk, H. Okasha, G. Alsmeyer, M. Wrede,
A. Caliebe, A. Irle (Foto U. Rösler)

Das gedrängte Programm mit den Vorträgen

L. Willert: Zur Konvergenz des Klassifikationsrisikos,

A. Caliebe: Symmetrische Lösungen von stochastischen Fixpunktgleichungen,

H. Okasha: Analyse einer Quicksort-Variante,

M. Wendt: Entropietheorie und dynamische Systeme,

M. Jaeger: Eine Verallgemeinerung der Itô-Formel und ihre Anwendung auf Probleme des optimalen Stoppens,

J. Konopka: Gleichmäßig beste sequentielle Tests der Güte 1,

D. Völker: Nichtparametrische Optimalitätseigenschaften optimaler parametrischer Tests,

M. Wrede: Schwierigkeiten bei der Bewertung europäischer Calls in unvollständigen zeitdiskreten Märkten,
 D. Kuhlbusch: Grenzwertsätze für normierte gewichtete Verzweigerungsprozesse in zufällig variierenden Umgebungen,
 H. Kösters: Probleme bei der Konstruktion optimaler Mehrfachstopregeln,
 zeigte wieder einmal die vielfältigen Themen der beteiligten Arbeitsgruppen.

An Veröffentlichungen erschienen im Jahr 2002 insbesondere:

- G. Alsmeyer (gem. mit V.Hoefs): Markov renewal theory for stationary $(m + 1)$ -block factors: Convergence rate results. *Stochastic Process. Appl.* 98 (2002), 77 – 112
- (gem. mit U. Rösler (Kiel)): Asexual versus promiscuous bisexual Galton-Watson processes: The extinction probability ratio. *Ann. Appl. Probab.* 12 (2002), 259 – 142
- : The minimal subgroup of a random walk. *J. Theoret. Probab.* 15 (2002), 259 – 283
- J. Konopka; N. Schmitz: Redundant observations at testing i.i.d. random variables. *Statist. Papers* 43 (2002), 595 – 602
- D. Plachky: From optimality robustness to sufficiency and completeness. *Statistics* 36 (2002), 139 – 146

Außerdem berichtete der Ref. in einem Beitrag “Mathematics in the Hall of Peace” des *Math. Intelligencer* 2002 u. a. über die Holzschnitzereien “Arithmetica” und “Geometria” im Friedenssaal des Münsterschen Rathauses. Zum Ende des Jahres 2002 gab Prof. Plachky nach über 20-jähriger Tätigkeit die Herausgeberschaft der Zeitschrift “Statistics & Decisions” ab.

Mit Schreiben vom 01.10.2002 erteilte das Ministerium für Wissenschaft und Forschung des Landes Nordrhein-Westfalen dem Erstplatzierten auf der o. g. Berufungsliste

Prof. Dr. Holger Dette

den Ruf für die zu besetzende C4-Professur “Mathematische Stochastik”,¹⁰⁶ einem jungen, aber bereits sehr renommierten Vertreter der Mathematischen Statistik, der sich insbesondere im Bereich der optimalen Versuchsplanung (und deren Zusammenhang mit orthogonalen Polynomen) einen sehr guten Namen gemacht hatte. Weil Prof. Dette in Bochum bereits eine C4-Professur innehatte, war abzusehen, dass die Berufungsverhandlungen nicht einfach werden würden.

¹⁰⁶Holger Dette wurde am 04.05.1961 geboren. Er studierte in Hannover und wurde dort 1989 zum Dr. rer. nat. promoviert. Anschließend arbeitete er als Wissenschaftlicher Mitarbeiter an der Universität Göttingen – zunächst in der Medizinischen Statistik und dann am Institut für Mathematische Stochastik. 1992 habilitierte er sich an der Universität Hanover. Nach einer zweijährigen Tätigkeit auf einer C3-Professur an der Technischen Universität Dresden übernahm er 1995 einen Lehrstuhl an der Ruhr-Universität Bochum. 1999 hatte er einen Ruf auf eine C4-Stelle an der Universität Karlsruhe erhalten, jedoch abgelehnt.

Bei diesen Verhandlungen spielte die Wiederzuweisung der C4-Professur des Ref. eine wichtige Rolle. Am 20.10.2002 beschloss der Fachbereichsrat einstimmig, die Wiederzuweisung mit der Ausrichtung "Mathematische Stochastik" zu beantragen. Nach der Beschaffung von umfangreichem Datenmaterial, das bei dieser Wiederbeantragung beizubringen war, stellte der Dekan Prof. Dr. Frank Natterer am 19.11.2002 den entsprechenden Antrag an das Rektorat der WWU. Bereits in seiner Sitzung am 19.12.2002 beschloss das Rektorat die Wiederzuweisung. Die Ausschreibung erfolgte dann mit dem Bewerbungstermin 30.04.2003:



Am Fachbereich Mathematik und Informatik ist zum Wintersemester 2004/2005 eine

C4-Professur für Mathematische Stochastik (Nachfolge Prof. Dr. N. Schmitz)

zu besetzen.

Die Stelleninhaberin/Der Stelleninhaber soll das Fach in Forschung und Lehre in voller Breite mit einem Schwerpunkt in Stochastische Prozesse, Mathematische Statistik, Stochastische Analysis, Finanzmathematik, Stochastische Algorithmen, Computational Statistics, o. ä. vertreten. Darüber hinaus soll sie/er sich an der Anfängerausbildung im Fachbereich und der mathematischen Betreuung Studierender anderer Fachbereiche angemessen beteiligen.

Voraussetzung für eine Bewerbung sind wissenschaftliche Leistungen, die durch eine Habilitation oder durch gleichwertige wissenschaftliche Leistungen, welche auch in einer Tätigkeit außerhalb des Hochschulbereichs erbracht sein können, nachgewiesen werden.

Bewerbungen von Frauen sind ausdrücklich erwünscht. Frauen werden bei gleicher Eignung, Befähigung und fachlicher Leistung bevorzugt berücksichtigt, sofern nicht in der Person eines Mitbewerbers liegende Gründe überwiegen.

Bewerbungen mit den üblichen Unterlagen (Lebenslauf, Schriftenverzeichnis, Angabe über die bisherige Lehrtätigkeit) sind bis zum **30.04.2003** zu richten an:
Dekan des Fachbereichs Mathematik und Informatik, Westfälische Wilhelms-Universität, Einsteinstr. 62, D-48149 Münster.

Trotz der sehr dankenswerten Unterstützung durch das Rektorat der WWU gelang es nicht, bei den Berufungsverhandlungen mit Prof. Dette mit dem Bleibeangebot der Universität Bochum zu konkurrieren (und die Nicht-Transferierbarkeit seiner Beteiligung an dem SFB 475 "Komplexitätsreduktion in multivariaten Datenstrukturen" der Universität Dortmund war ein weiteres Handikap für Münster). Am Ende der erfreulich zügig und zielgerichtet verlaufenen Verhandlungen entschied sich Prof. Dette Ende 2002, den Ruf nach Münster abzulehnen und an der Ruhr-Universität Bochum zu bleiben.

Bereits am 13.01.2003 bat das Rektorat der WWU in einem Schreiben an das Ministerium, angesichts der Rufablehnung durch Prof. Dette den Zweitplatzierten auf der Liste,

Univ.-Doz. Dr. Matthias Löwe

zu berufen. Tatsächlich reagierte das Ministerium prompt; mit Schreiben vom 24.01.2003

wurde Herrn Löwe, der eine Universitätsdozentur für Finanzmathematik an der Universität Nimwegen (Katholieke Universiteit Nijmegen; Niederlande) innehatte, der Ruf erteilt.

Inzwischen drängte die Zeit: Prof. Dr. Detlef Plachky wurde nach über 30-jähriger Tätigkeit als ordentlicher Professor und Direktor des Instituts für Mathematische Statistik zum 01.03.2003 emeritiert und verließ das Institut.

Dank der vorherigen Aktivitäten konnten die Berufungsverhandlungen mit Herrn Löwe zügig zum Abschluss gebracht werden. Noch im April entschied er sich für Münster; mit Wirkung vom 01.07.2003 wurde er zum Universitätsprofessor der Besoldungsgruppe C4 für das Fach “Mathematische Stochastik” ernannt.



Prof. Dr. Matthias Löwe

Matthias Löwe wurde am 29.10.1964 in Bad Oeynhausen geboren. Von 1984 bis 1990 studierte er an der Universität Bielefeld; 1990 erwarb er das Diplom in Mathematik. Von 1990 bis 1992 war er dort Mitglied des Graduiertenkollegs Mathematik. 1992 wurde er mit der von Friedrich Götze betreuten Dissertation “Exponential Inequalities and Principles of Large Deviations for U-Statistics and von-Mises-Statistics” an der Universität Bielefeld zum Dr. rer. nat. promoviert. Ab 1992 war er Wissenschaftlicher Assistent am Fachbereich Mathematik der Universität Bielefeld, von Ende 1998 bis Mitte 2002 Postdoc in der ISS (Interacting Stochastic Systems)-Gruppe am EURANDOM (Eindhoven/Niederlande). Im Mai 2000 habilitierte er sich an der Universität Bielefeld mit der Schrift “Neural Networks, Spin Glasses and Reconstruction of Random Scenery”. Von September 2000 bis zu seiner Ernennung in Münster wirkte er als Universitätsdozent an der Faculteit der Natuurwetenschappen, Wiskunde en Informatica der Katholieke Universiteit Nijmegen (Niederlande).

Mit der Berufung von Prof. Löwe, in dessen breiten Arbeitsgebieten die Statistische Physik eine besondere Rolle spielt, war ein erster großer Schritt für eine erfolgreiche Zukunft des Instituts getan. Prof. Löwe konnte dann bereits an der ersten Sitzung der Berufungskommission “Nachfolge Schmitz” am 14.05.2003 teilnehmen. Auf die Ausschreibung

dieser Stelle waren 59 Bewerbungen eingegangen. Nach ausführlichen Diskussionen, bei denen die fachliche Ausrichtung dieser zweiten C4-Professur eine wichtige Rolle spielte, entschloss sich die Kommission unter dem Vorsitz von Prof. Dr. Anton Arnold, sechs Bewerber/innen zu Vorstellungsvorträgen einzuladen. Diese wurden für den Oktober 2003 terminiert.

Die Tradition der Kiel-Münster-Kolloquien “Mathematische Stochastik” wurde am 10./11. Mai 2003 in Kiel fortgesetzt; wieder gab es ein vielseitiges Programm:

- G. Alsmeyer: Ein Erneuerungssatz für gewichtete Verzweigungsprozesse,
- D. Kuhlbusch: Zur Existenz von Momenten bei gewichteten Verzweigungsprozessen,
- H. Kösters: Prophetenungleichungen im iid-Fall bei Beobachtungskosten,
- C. Prelle: Finanzmarktmodelle bei stochastischer Volatilität,
- M. Jaeger: Eine exotische Option bei spektral negativen Lévy-Prozessen,
- D. Völker: Permutationstests für zufällig zensierte Daten,
- V. Paulsen: Optimales Stoppen bei linearen Kosten,
- D. Knof: FIND als Maß auf $D[0, 1]$,
- M. Wendt: Potentialtheorie in der komplexen Dynamik.



Die Teilnehmer am 8. Kiel-Münster-Kolloquium
Obere Reihe: A. Irle, A. Caliebe, D. Kuhlbusch, M. Wrede,
H. Kösters, J. Konopka, C. Prelle, M. Jaeger
Vordere Reihe: N. Schmitz, G. Alsmeyer, L. Willert, D. Völker, J.-H. Lee,
M. Wendt, V. Paulsen (Foto U. Rösler)

Noch bevor die Vorstellungsvorträge für die Stelle “Nachfolge Schmitz” stattgefunden hatten und somit die nächsten Weichenstellungen für die Zukunft des Instituts erfolgen

konnten, gab es eine für den Betroffenen sehr erfreuliche, für das Institut aber beunruhigende neue Entwicklung: Am 12.10.2003 erhielt Prof. Dr. Gerold Alsmeyer einen Ruf auf eine C4-Professur für Stochastik und Mathematische Statistik an der Philipps-Universität Marburg. Weil davon auszugehen war, dass er diese ehrenvolle Berufung annehmen würde, war die weitere Entwicklung des Instituts plötzlich wieder sehr unsicher.

Trotz all dieser Veränderungen und Unsicherheiten konnte die Lehr- und Forschungsarbeit jedoch erfolgreich fortgesetzt werden: Am 17.12.2003 wurde Jörg Konopka mit der Dissertation "Gleichmäßig beste sequentielle Tests bei unabhängigen Versuchswiederholungen" zum Dr. rer. nat. promoviert.



Dr. Jörg Konopka

Zum 01.10.2003 wurde Herr Dipl.-Math. Gunnar Jansen als Wissenschaftlicher Mitarbeiter im Rahmen der Arbeitsgruppe von Herrn Alsmeyer eingestellt. Am 31.07.2003 war der Vertrag von Jörg Konopka, der u. a. ein umfangreiches Statistik-Praktikum organisiert hatte, ausgelaufen; neben dem Abschluss seiner Promotion unterrichtete er dann bereits an verschiedenen Schulen.

Im Forschungsbericht konnte eine umfangreiche Publikationsliste vorgelegt werden, insbesondere:

G. Alsmeyer: On the Harris recurrence of iterated random Lipschitz functions and related convergence rate results. *J. Theoret. Probab.* 16 (2003), 217 – 247

— (gem. mit U. Rösler): The best constant in the Topchii-Vatutin inequality for martingales. *Statist. Probab. Lett.* 65 (2003), 199 – 206

M. Löwe (gem. mit H. Matzinger): Reconstruction of sceneries with correlated colors. *Stochastic Process. Appl.* 105 (2003), 175 – 210

— (gem. mit P. Eichelsbacher): Moderate deviations for i.i.d. random variables. *ESAIM Prob. Stat.* 7 (2003), 209 – 218

M. Löwe (gem. mit P. Eichelsbacher): Geduld und Zufall. Stochastik in der Schule 23 (2003), 2 – 7

—: Wer tauscht, gewinnt. Stochastik in der Schule 23 (2003), 21 – 24

D. Völker; N. Schmitz: Nonparametric optimality properties of optimal parametric tests. Allg. Statistisches Archiv 87 (2003), 353 – 367

2004 wurde zu einem Jahr der Ernte und des Neubeginns. Nicht weniger als vier Promotionsvorhaben kamen zum erfolgreichen Abschluss: Am 04.02.2004 wurden Dominik Völker mit der Dissertation “Finit optimale nichtparametrische Tests für Lebensdauerdaten” und Marcus Wrede mit der Dissertation “Bewertung von Derivaten in zeitdiskreten Finanzmarktmodellen” zum Dr. rer. nat. promoviert, am 21.07.2004 folgten



Dr. Marcus Wrede

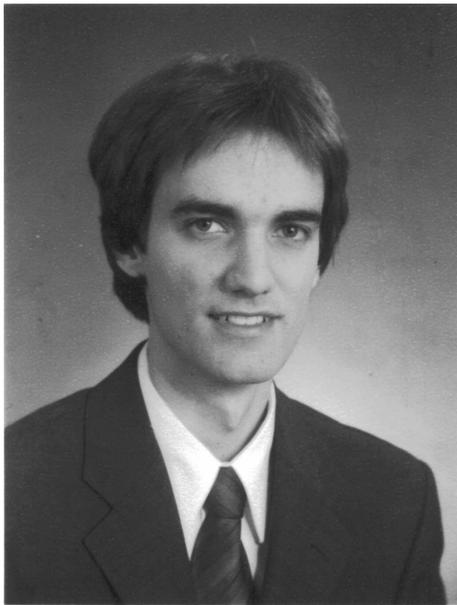


Dr. Dominik Völker

Holger Kösters mit der Dissertation “Prophetentheorie bei Mehrfachauswahlen” und Dirk Kuhlbusch mit der Dissertation “Moment Conditions for Weighted Branching Processes”. Dominik Völker wechselte zum 01.06.2004 zu einer Versicherungsgesellschaft, Dirk Kuhlbusch ging zum 01.09.2004 zu einer Rückversicherung und Marcus Wrede im März 2004 zu einem Bundesamt für Finanzwesen. Holger Kösters wechselte zum 01.08.2004 von der DFG-Stelle auf eine Stelle als Wissenschaftlicher Mitarbeiter am Institut.

Ein nachträgliches “Highlight” bei der Dissertation von Holger Kösters war, dass ihm für diese Leistung am 14.01.2005 im Rahmen des Neujahrsempfangs der WWU ein Dissertationspreis 2004 der Westfälischen Wilhelms-Universität Münster verliehen wurde (s. a. S. 233/234).

Am 21.01.2004 hielt Prof. Löwe seine Antrittsvorlesung zum Thema “Stochastische Prozesse in zufälligen Medien”.



Dr. Holger Kösters



Dr. Dirk Kuhlbusch

Nachdem sich die Berufungsverhandlungen von Prof. Alsmeyer in Marburg zunächst vielversprechend angegangen hatten, gerieten sie dadurch ins Stocken, dass verbale Inaussichtstellungen nicht fixiert werden konnten – die Stellen- und Mittelkürzungen an den hessischen Hochschulen forderten auch von der Philipps-Universität Marburg einen hohen Tribut. Andererseits konnten Institut, Fachbereich und Rektorat der WWU Münster einigen Wünschen von Prof. Alsmeyer entgegenkommen, wobei das “Zeitfenster” allerdings nicht sehr groß war. Nach schwierigen Abwägungen entschloss sich Prof. Alsmeyer am 16.02.2004, den Ruf nach Marburg insbesondere auch im Hinblick auf die positiven Zukunftschancen des Instituts in Münster abzulehnen. Damit war ein zweiter großer Schritt für eine weitere erfolgreiche Entwicklung des Instituts für Mathematische Statistik getan.

Schon am 04.11.2003 hatte die Berufungskommission für die Professur “Nachfolge Schmitz” einstimmig einen Berufungsvorschlag verabschiedet. Nach dem Einholen weiterer auswärtiger Gutachten wurde dieser am 28.01.2004 vom Fachbereichsrat des Fachbereichs Mathematik und Informatik einstimmig beschlossen; die Professoren des Fachbereichs stimmten der Berufsungsliste ebenfalls einhellig zu. Nach Vervollständigung der erforderlichen Unterlagen legte der Dekan Prof. Dr. Klaus Hinrichs im März 2004 dem Rektorat der WWU den Berufungsvorschlag vor. Weil jedoch ein Rektoratsmitglied Einfluss auf die fachliche Ausrichtung der Stelle nehmen wollte, verzögerte es sich bis zum 30.09.2004, dass die Erstplatzierte, die Professorin am Institut für Mathematische Stochastik der Universität (TH) Karlsruhe,

Prof. Dr. Nina Gantert

den Ruf erhielt.

In der letzten “Pflichtvorlesung” des Ref. am 30.07.2004 sorgte Prof. Dr. Helmut Maurer gemeinsam mit den Studentinnen Melanie Müller und Sabine Reintges für einen musikalischen Ausklang der über 40-jährigen Dienstzeit.

Aus Anlass der Emeritierung des Ref., die zum 31.08.2004 erfolgt war, veranstaltete der Fachbereich Mathematik und Informatik am 29.10.2004 ein Kolloquium. Nach einer Begrüßung durch den Dekan des Fachbereichs Prof. Dr. Klaus Hinrichs und Grußworten von stud. math. Markus Förster für die Fachschaft und Prorektor Prof. Dr. Harald Züchner für die Universität hielten die drei Autoren des Teubner-Studienbuchs “Spieltheorie” allgemeinverständliche Vorträge für das breit gefächerte Auditorium:



Prof. Dr. Klaus Hinrichs



Markus Förster



Prof. Dr. Harald Züchner

Prof. Dr. Burkhard Rauhut, Rektor der Rheinisch-Westfälischen Technischen Hochschule Aachen und Direktor des dortigen Instituts für Statistik und Wirtschaftsmathematik, sprach über

“Alma Mater – und wie sag’ ich es meinen Alumni?”

Prof. Dr. Ernst-Wilhelm Zachow, Vorstandsvorsitzender der LKH und LLH Lüneburg und Honorarprofessor der Philipps-Universität Marburg, referierte über

“Überlegungen zu den aktuellen Vorschlägen für eine Umgestaltung des deutschen Krankenversicherungssystems”



Prof. Dr. Burkhard Rauhut



Prof. Dr. Ernst-Wilhelm Zachow

und der Ref. über

“Wie oft sollte man Karten mischen?”



Prof. Dr. Norbert Schmitz



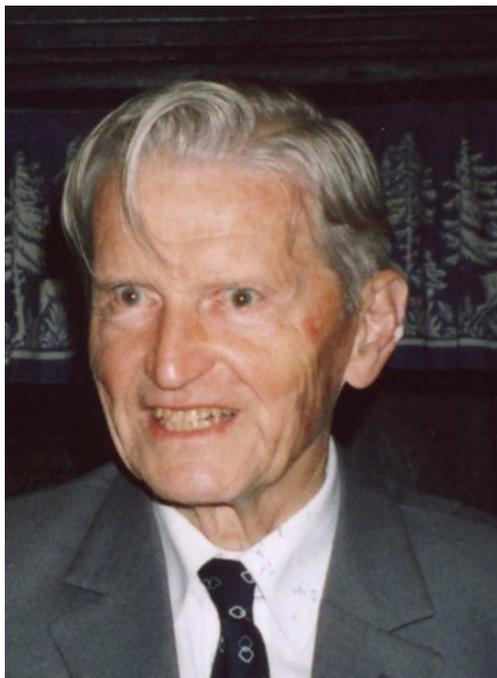
Marlene Schmitz

Die musikalische Umrahmung des Kolloquiums – mit dem “Entertainer” als Abschluss –

hatte die Pianistin (und Ehefrau des Ref.) Marlene Schmitz übernommen.



Zu diesem Kolloquium waren auch die drei früheren Direktoren des Instituts und akademischen Lehrer des Ref.



Prof. Dr. Dietrich Morgenstern



Prof. Dr. Dietrich Bierlein

und



Prof. Dr. Dr. h.c. Hermann Witting

sowie die designierte Nachfolgerin



Prof. Dr. Nina Gantert

gekommen – so schloss sich ein großer Kreis.

Außerdem waren zu diesem Kolloquium auch die Teilnehmer des

7. Alumni-Treffens

eingeladen, das am nächsten Tag, dem 30.10.2004, stattfand. Wieder gaben die Vorträge ein eindrucksvolles Bild von den vielfältigen und vielseitigen Tätigkeitsbereichen von Mathematikern:

Dr. Marcus Wrede (Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht, Bonn):
“Bewertung von Finanzderivaten”

Prof. Dr. Dietmar Zietsch (Vorstandsvorsitzender der SCOR Deutschland, Hannover):
“Betriebswirtschaftliche und mathematische Aspekte einer zeitgemäßen wertorientierten Steuerung in Rückversicherungsunternehmen”

Dr. Kristina Unnebrink (ABBOTT GmbH & Co. KG, Ludwigshafen):
“Biometrie in klinischen Studien”

Dipl.-Math. Wolfgang Rentmeister (Bertelsmann AG, Gütersloh):
“Globales Datenmanagement für technische Informationen in internationalen Unternehmen”

Dr. Franz-Josef Tietmeyer (Siemens AG, München):
“Prozesse und Metriken in der Entwicklung von Telekommunikationssystemen”

Dipl.-Math. Frank Iding (European Landmine Solutions, Essen):
“Landminen – Betrachtung eines vielschichtigen Problems”



7. Alumni-Treffen

Nachdem Frau Gantert am 30.09.2004 den Ruf erhalten hatte, nahm sie unverzüglich die Berufungsverhandlungen auf. Diese konnten im November erfolgreich abgeschlossen werden; zum 01.12.2004 wurde sie zur Universitätsprofessorin der Besoldungsgruppe C4 für das Fach “Mathematische Stochastik” ernannt (zu biographischen Daten vgl. das Kapitel 7).

Damit war auch der dritte große Schritt zur Neustrukturierung des Instituts getan. Nach etlichen Jahren der Unsicherheit konnten nun neue Ziele gesetzt und angegangen werden ohne dabei die bisherigen Stärken – insbesondere die deutschlandweite Spitzenstellung in der Ausbildung von leistungsstarken Diplom-Mathematikern/innen (s. a. Abschnitt 6.5) – aufzugeben.

Der Neubeginn dokumentierte sich auch bei den Publikationen; es erschienen u. a.:

- G. Alsmeyer (gem. mit V. Hoefs): Markov renewal theory for stationary $(m + 1)$ -block factors: First passage time and overshoot. *Comm. Statist. Theory Methods* 33 (2004), 545 – 568
- (gem. mit U. Rösler): On the existence of ϕ -moments of the limit of a normalized supercritical Galton-Watson process. *J. Theoret. Probab.* 17 (2004), 905 – 928
- N. Gantert (gem. mit A. Dembo und O. Zeitouni): Large deviations for random walks in random environment with holding times. *Ann. Probab.* 32 (2004), 996 – 1029
- H. Kösters: Difference prophet inequalities for $[0, 1]$ -valued i.i.d. random variables, with cost for observations. *Ann. Probab.* 32 (2004), 3324 – 3332
- : On multiple stopping rules. *Optimization* 53 (2004), 69 – 75
- : Prophetentheorie bei Mehrfachauswahlen. *Dissertationsnachdruck*, Münster 2004
- D. Kuhlbusch: On weighted branching processes in random environment. *Stochastic Process. Appl.* 109 (2004), 113 – 144
- : Moment Conditions for Weighted Branching Processes (*Dissertationsnachdruck*). *Angewandte Mathematik und Informatik* 12/04 - S
- M. Löwe (gem. mit P. Eichelsbacher): Moderate deviations for the overlap parameter in the Hopfield model. *Probab. Theory Related Fields* 130 (2004), 441 – 472
- (gem. mit P. Eichelsbacher): Moderate deviations for a class of mean-field models. *Markov Proc. Related Fields* 10 (2004), 345 – 367
- (gem. mit H. Matzinger und F. Merkl): Reconstructing a multicolor random scenery seen along a random walk path with bounded jumps. *Electronic J. Probab.* 9 (2004), 436 – 507
- (gem. mit S. Alink und M. Wüthrich): Diversification of aggregate dependent risks. *Insurance Math. Econom.* 35 (2004), 77 – 95
- (gem. mit M. Baake): Comment on: Curious properties of simple random walks. *Stat. Phys.* 116 (2004), 1449 – 1451
- N. Schmitz: Discussion on “Likelihood Ratio Identities and Their Applications to Sequential Analysis” by Tse L. Lai. *Sequential Anal.* 23 (2004), 507 – 508
- D. Völker: Finit optimale nichtparametrische Tests für Lebensdauerdaten.

(Dissertationsnachdruck). Angewandte Mathematik und Informatik 6/04 - S

M. Wrede: Bewertung von Derivaten in zeitdiskreten Finanzmarktmodellen. (Dissertationsnachdruck). Angewandte Mathematik und Informatik 1/04 - S

Auch in der Dekade 1994 – 2004 wurden im Rahmen der gemeinsam mit der “Gesellschaft zur Förderung der Mathematischen Statistik” herausgegebenen Reihe

“Skripten zur Mathematischen Statistik”

als Lehrmaterial für die Studierenden etliche Vorlesungsmanuskripte herausgegeben:

N. Schmitz: Einführung in die Maß- und Integrationstheorie (Skript 14); 4. Aufl. 1994

N. Schmitz: Vorlesungen über Mathematische Statistik (Skript 24), 1994; 2. Aufl. 1996

N. Schmitz: Vorlesungen über Stochastik (Skript 21), 3. überarb. Aufl. 1995

A. Janssen (Univ. Düsseldorf): Zur Asymptotik nichtparametrischer Tests (Skript 29), 1998

G. Alsmeyer: Wahrscheinlichkeitstheorie (Skript 30), 1998; 2. Aufl. 2000, 3. erw. Aufl. 2003

G. Alsmeyer: Stochastische Prozesse. Teil 1: Diskrete Markov-Ketten, Martingale und Erneuerungstheorie (Skript 33), 2000; 2. erw. Aufl. 2002

L. Dümbgen (Univ. Lübeck): Empirische Prozesse (Skript 35), 2000

G. Alsmeyer: Mathematische Statistik (Skript 36), 2002; 2. Aufl. 2004

B. Rauhut (RWTH Aachen)/N. Schmitz/E. W. Zachow (LKH Lüneburg): Mathematische Spieltheorie (Skript 37; durchges. Nachdruck des Teubner-Studienbuchs “Spieltheorie” von 1979), 2002

P. Eichelsbacher (Univ. Bochum): Die Steinsche Methode (Skript 38), 2003

Schließlich übernahmen die Mitglieder des Instituts ebenso wie in den vorherigen Jahren auch in der Dekade 1994 – 2004 ein Fülle von Aufgaben in der akademischen Selbstverwaltung und in Wissenschaftsorganisationen. So war Prof. Alsmeyer u. a. von 1995 bis 2004 ord. Mitglied des Fachbereichsrats, übernahm in den schwierigen Jahren von 1999 bis 2004 die geschäftsführende Leitung des Instituts, war Mitglied und Vorsitzender der Berufungskommission “Mathematische Logik und Grundlagenforschung” (Nachfolge Diller) und Mitglied der Berufungskommissionen “Nachfolge Plachky” und “Nachfolge Schmitz”. Frau Forstmann war u. a. mehrere Jahre ord. bzw. stellv. Mitglied des Fachbereichsrats, von 1994 bis 2001 Mitglied des Ausschusses für Forschung und wissenschaftlichen Nachwuchs (AFWiN) des Fachbereichs und 2000/2001 Mitglied der Strukturkommission des Fachbereichs. Frau Kollwitz war während der gesamten Dekade Mitglied des Ausschusses für Lehre und studentische Angelegenheiten (ALSA) des Fachbereichs. Die Herren Kuhlbusch, A. Meyerthole und Thomsen waren Mitglieder von Berufungskommissionen. Prof. Plachky übernahm bis 1999 im Wechsel mit dem Ref. die geschäftsführende Leitung des Instituts; von 1994 bis 2003 war er Vorsitzender des Prüfungsausschusses für Diplom-

Mathematiker. Der Ref. war u. a. 1994 Mitglied und Sprecher der Professoren im Konvent der WWU, 1997 – 2002 Mitglied der Kommission für Finanz- und Personalangelegenheiten (KFPA) der WWU, 1997 – 1999 Dekan und 1999 – 2002 Prodekan der Mathematisch-Naturwissenschaftlichen Fakultät der WWU, mehrere Jahre ord. Mitglied des Fachbereichsrats des Fachbereichs Mathematik und Informatik, 2000 – 2002 Mitglied und Vorsitzender der Strukturkommission des Fachbereichs, Mitglied und Vorsitzender der Berufungskommissionen “C4-Professur für Mathematik” (Nachfolge Nastold), “C4-Professur für Mathematik” (Nachfolge Remmert), “C3-Professur für Mathematik, insbesondere Differentialgeometrie oder nicht-kommutative Geometrie”, “C4-Professur für Mathematik, insbesondere Differentialgeometrie” (Nachfolge Meyer) und “Zwei C3-Professuren für Reine Mathematik” sowie Mitglied von drei weiteren Berufungskommissionen (davon eine an der TU Dresden), 1995 – 2002 Mitglied des Verwaltungsausschusses der Gesellschaft zur Förderung der WWU, 1995 – 2002 Mitglied der Fachkommission “Mathematik” der Hochschul-Rektoren-Konferenz (HRK), 1997/98 Gutachter im Projekt “Evaluation von Studium und Lehre” des Verbundes Norddeutscher Universitäten und von 1996 bis 1999 Mitglied des Präsidiums der Deutschen Mathematiker Vereinigung (DMV). Und auch die “Neuen” wurden sofort in die administrative Pflicht genommen: Prof. Löwe wurde schon vor seiner Ernennung Mitglied der Berufungskommission “Nachfolge Schmitz”; 2004 wurde er Vorsitzender des Prüfungsausschusses für Diplom-Mathematiker und Mitglied des Ausschusses für Lehre und studentische Angelegenheiten (ALSA) des Fachbereichs. Ebenfalls bereits vor ihrer Ernennung wurde Prof. Gantert Mitglied in zwei Berufungskommissionen (“Reine Mathematik mit Schwerpunkt Mathematische Physik” und “Praktische Informatik”).