



TECHNISCHE UNIVERSITÄT DRESDEN
Fakultät Wirtschaftswissenschaften

Dresdner Beiträge zu
Quantitativen Verfahren

Nr. 70/17

Theorie und Methodik der Statistik

von

Stefan Huschens

Herausgeber:
Die Professoren der
Fachgruppe Quantitative Verfahren
ISSN 0945-4802



Dresdner Beiträge zu Quantitativen Verfahren (ISSN 0945-4802)

Ältere Ausgaben (1/94 – 48/08): <http://www.qvs.file3.wcms.tu-dresden.de/f-db.htm>

- 49/09 E. Lovász, B. Schipp: The Impact of HIV/AIDS on Economic Growth in Sub-Saharan Africa. Erschienen in: *South African Journal of Economics*, Vol. 77, Nr. 2, 2009, S. 245-256.
- 50/09 S. Höse, S. Huschens: Confidence Intervals for Correlations in the Asymptotic Single Risk Factor Model.
- 51/10 S. Höse, S. Huschens: Confidence Intervals for Quantiles of a Vasicek-distributed Credit Portfolio Loss.
- 52/10 D. Tillich: Risikomaßzahlen für Kreditportfoliotranchen. Erschienen in: *ASTA Wirtschafts- und Sozialstatistisches Archiv*, Vol. 5, Nr. 1, 2011, S. 59-76. DOI: 10.1007/s11943-011-0095-1
- 53/10 S. Huschens: Kann es Rückzahlungswahrscheinlichkeiten von 100% geben? Erschienen in: *bank und markt – Zeitschrift für Retailbanking*, 39. Jg., Heft 3/2010, S. 11.
- 54/11 S. Höse, S. Huschens: Confidence Intervals for Asset Correlations in the Asymptotic Single Risk Factor Model. Erschienen in: *Operations Research Proceedings 2010*, Hrsg: B. Hu, K. Morasch, S. Pickl, M. Siegle, Springer, Berlin, 2011, S. 111-116.
- 55/11 S. Höse, S. Huschens: Stochastic Orders and Non-Gaussian Risk Factor Models. Erschienen in: *Review of Managerial Science*. Vol. 7, Nr. 2, 2013, S. 99-140. DOI: 10.1007/s11846-011-0071-8
- 56/11 D. Tillich: Bounds for the Expectation of Bounded Random Variables. DOI: 10.13140/RG.2.1.2656.7768
- 57/12 S. Höse, S. Huschens: Credit Portfolio Correlations and Uncertainty. Erschienen in: *Credit Securitizations and Derivatives – Challenges for the Global Markets*, Hrsg.: D. Rösch, H. Scheule, Wiley: Chichester, 2013, S. 53-70
- 58/12 S. Fischer: Ratio calculandi periculi - Ein analytischer Ansatz zur Bestimmung der Verlustverteilung eines Kreditportfolios
- 59/13 D. Tillich, D. Fergner: Estimation of Rating Classes and Default Probabilities in Credit Risk Models with Dependencies. Erschienen in: *Applied Stochastic Models in Business and Industry*, Vol. 31, Nr. 6, 2015, S. 762-781. DOI: 10.1002/asmb.2089
- 60/14 C. Lehmann, D. Tillich: Consensus Information and Consensus Rating – A Note on Methodological Problems of Rating Aggregation. Erschienen in: *Operations Research Proceedings 2014*, Hrsg.: M. Lübbecke et al., Springer, 2016, S. 357-362. DOI: 10.1007/978-3-319-28697-6_50
- 61/15 C. Lehmann, D. Tillich: Applied Consensus Information and Consensus Rating – A Simulation Study on Rating Aggregation. Erschienen in: *Journal of Risk Model Validation* Jg. 10, Heft 4, 2016, S. 1-21.
- 62/16 C. Lehmann: Modellierung der Abhängigkeitsstruktur von Ausfallkörben – Eine Betrachtung für den Spezialfall des Duo-Baskets.
- 63/16 S. Huschens: Chance (*odd*) versus Wahrscheinlichkeit (*probability*).
- 64/16 S. Huschens: Stetigkeit in der Statistik.
- 65/16 S. Huschens: Literaturlauswahl zur Statistik.
- 66/16 D. Tillich, C. Lehmann: Estimation in discontinuous Bernoulli mixture models applicable in credit rating systems with dependent data.
- 67/16 D. Tillich: Generalized Modeling and Estimation of Rating Classes and Default Probabilities Considering Dependencies in Cross and Longitudinal Section.
- 68/17 S. Huschens: Risikomaße.
- 69/17 S. Huschens: Einführung in die Ökonometrie.
- 70/17 S. Huschens: Theorie und Methodik der Statistik.