

Dietmar Pfeifer

Schriftenverzeichnis

Stand: Oktober 2024

Schriften zum Risikomanagement

**Editors: Prof. Dr. Angelika May, Prof. Dr. Dietmar Pfeifer,
Prof. Dr. Jörg Prokop, Prof. Dr. Jürgen Taeger**

1. Sandra Lüth (2009): Mindestanforderungen an das Risikomanagement: Eine Herausforderung für Kreditinstitute und Bankenaufsicht. Oldenburger Verlag für Wirtschaft, Informatik und Recht (OLWIR), Edewecht, ISBN: 978-3-939704-38-6
2. Benjamin Seegmüller (2011): Einrichtung und Prüfung eines Risikofrüherkennungs- und Überwachungssystems in der Genossenschaft. Oldenburger Verlag für Wirtschaft, Informatik und Recht (OLWIR), Edewecht, ISBN: 978-3-939704-62-1
3. Christian Jakob (2015): Gesellschaftsrechtliche Anforderungen an Risikomanagementsysteme. Oldenburger Verlag für Wirtschaft, Informatik und Recht (OLWIR), Edewecht, ISBN: 978-3-95599-017-6
4. Thomas O. Winkler (2016): Auswirkungen eines operativen Risikomanagements auf den Schadenverlauf von Kraftfahrzeug-Flotten. Oldenburger Verlag für Wirtschaft, Informatik und Recht (OLWIR), Edewecht, ISBN: 978-3-95599-028-2

Mathematische Grundlagen der Informatik

**Editors: Prof. Dr. Dietmar Pfeifer, Prof. Dr. Walter Oberschelp,
Prof. Dr. Rolf Möhring**

1. Gerald Schmieder (1994): Analysis. Eine Einführung für Mathematiker und Informatiker. Vieweg-Verlag, ISBN 978-3-528-05418-2, ISBN 978-3-322-89210-2 (eBook)
2. Helmuth Späth (1994): Numerik. Eine Einführung für Mathematiker und Informatiker. Vieweg-Verlag, ISBN 978-3-528-05389-5, ISBN 978-3-322-89220-1 (eBook)
3. Gerhard Hübner (1996): Stochastik. Eine anwendungsorientierte Einführung für Informatiker, Ingenieure und Mathematiker. Vieweg-Verlag, ISBN 978-3-528-05443-4, ISBN 978-3-663-11522-9 (eBook)

4. Hans-Joachim Bungartz, Michael Griebel, Christoph Zenger (1996): Einführung in die Computergraphik. Grundlagen, Geometrische Modellierung, Algorithmen. Vieweg-Verlag, ISBN 978-3-528-06769-4, ISBN 978-3-322-92925-9 (eBook)
5. Herbert Möller (1997): Algorithmische Lineare Algebra. Eine Einführung für Mathematiker und Informatiker. Vieweg-Verlag, ISBN 978-3-528-05528-8, ISBN 978-3-322-84939-7 (eBook)

Hamburger Reihe C: Versicherungs- und Finanzmathematik

Editor: Prof. Dr. Dietmar Pfeifer

1. Annette Kuck (2000): Abgrenzung traditioneller Rückversicherung von Katastrophenrisiken zu ausgewählten Konzepten des Alternativen Risikotransfers. Verlag Versicherungswissenschaft, Karlsruhe, ISBN: 3-88487-829-8
2. Volker Röhrs (2000): Sensitivitätsanalysen und adaptive Politiken zur Absicherung von Optionen in diskreter Zeit. Verlag Versicherungswissenschaft, Karlsruhe, ISBN: 3-88487-828-X
3. Sascha Wilkens (2000): Zur Eignung numerischer Verfahren für die Optionsbewertung. Mit einer ausführlichen Einführung in Derivatehandel und -bewertung. Verlag Versicherungswissenschaft, Karlsruhe, ISBN: 3-88487-844-1
4. André Führer (2001): Entwicklung eines Prämienmodells für die Warenkreditversicherung. Verlag Versicherungswissenschaft, Karlsruhe, ISBN: 3-88487-930-8
5. Erhard Kremer (2004): Einführung in die Risikotheorie der Verallgemeinerten Höchstschadenrückversicherung. Verlag Versicherungswissenschaft, Karlsruhe, ISBN: 3-88952-174-9

Sonstiges

1. **W. Gaul, D. Pfeifer (Eds.):** From Data to Knowledge: Theoretical and Practical Aspects of Classification, Data Analysis and Knowledge Organization, 1995, Springer, N.Y.
2. **Ch. Hennig and D. Pfeifer (Hrsg.):** Datenanalyse und Numerische Klassifikation: Beiträge zur Herbsttagung der AG DA-NK der Gesellschaft für Klassifikation, Hamburg, 5.-6.11. 1999. Hamburger Beiträge zur Modellierung und Simulation, Heft 13 (2000)
3. **M. Hallin, D. Mason, D. Pfeifer, J. Steinebach (Eds.):** Mathematical Statistics and Limit Theorems - Festschrift in Honour of Paul Deheuvels, Springer (2015), Heidelberg

Monographien zur Lehre

1. Statistische Ökologie (1997).
2. Diskrete Stochastische Finanzmathematik (2014).
3. Stochastik (2016).
4. Risikotheorie (2016).
5. Räumliche Statistik (2016).
6. Analytische Prinzipien der Stochastik (2016).
7. Quantitative Risk Management (2017).
8. Spezielle Themen des Risikomanagements (2019).
9. Monte Carlo Methoden (2022).

Eigene Arbeiten

2024

- [131] On an approximation of the total claims distribution in a modified collective risk model. *Fundamental Journal of Mathematics and Mathematical Sciences* (2024), Vol.18 (2), 79 – 86.
- [130] EXCEL-File zur Simulation einer Versicherungssparte (Filebeschreibung).
- [129] Eine elementare Näherungskonstruktion des regelmäßigen Neunecks mit Zirkel und Lineal. Unpublished Note. English Version: On an elementary approximate construction of the regular nonagon with ruler and compass. *Fundamental Journal of Mathematics and Mathematical Sciences* (2024), Vol. 18, Issue 2, 95-100.

2023

- [128] Reflections on a canonical construction principle for multivariate copula models. Unpublished Note.
- [127] For which complex numbers z is z^z real? Unpublished Note.
- [126] Anmerkungen zu Schurigs „algebraischer Lösung“ für den casus irreducibilis einer kubischen Gleichung. Unpublished Note.

2022

- [125] Ein neuer Ansatz zur Frequenzmodellierung im Versicherungswesen. *ZVersWiss* (2022), 465 - 472.
- [124] Eine elementare Näherungskonstruktion des regelmäßigen Elfecks mit Zirkel und Lineal. Unpublished Note.
- [123] Eine elementare Näherungskonstruktion des regelmäßigen Siebenecks mit Zirkel und Lineal. Unpublished Note. English Version: On an elementary approximate construction of the regular heptagon with ruler and compass.

Fundamental Journal of Mathematics and Mathematical Sciences (2024), Vol. 18, Issue 2, 87-93.

[122] A note on Cardano's formula. Annals of Mathematics and Physics (2024), 7(1), 64 – 66.

[121] A note on the estimation and simulation of distributions with Bernstein polynomials. Journal of Risk and Financial Studies 2022, Vol. 3 No. 1, 81 – 86.

2021

[120] Generating unfavourable VaR scenarios under Solvency II with patchwork copulas (with O. Ragulina). Dependence Modeling, 2021; 9; 327-346.

[119] Insurance Business and Sustainable Development (with V. Langen). In: M. Sarfraz and L. Ivascu (Eds): Risk Management, 3 - 18. InTechOpen, 2021.

2020

[118] Adaptive Bernstein copulas and risk management (with O. Ragulina). Mathematics 2020, 8, 2221.

2019

[117] Modellvalidierung mit Hilfe von Quantil-Quantil-Plots unter Solvency II. ZVersWiss (2019), 307 – 325.

[116] EXCEL files for the simulation of Partition-of-Unity copulas (with file description).

[115] New copulas based on general partitions-of-unity (part III) – the continuous case (with A. Mändle, O. Ragulina and C. Girschig). Dependence Modeling (2019), 181 – 201.

[114] Multivariate multiple test procedures based on nonparametric copula estimation (with A. Neumann, T. Bodnar and T. Dickhaus). Biometrical Journal 61 (2019), 40 – 61.

2018

[113] Generating VaR scenarios under Solvency II with product beta distributions (with O. Ragulina). RISKS 2018, 6, 122.

2017

[112] New copulas based on general partitions-of-unity and their applications to risk management (part II) (with A. Mändle and O. Ragulina). Dependence Modeling (2017), 246 – 255.

2016

- [111] Hält das Standardmodell unter Solvency II, was es verspricht? In: R. Koch, M. Weber, G. Winter (Hrsg.): Der Forschung – der Lehre – der Bildung. 100 Jahre Hamburger Seminar für Versicherungswissenschaft und Versicherungswissenschaftlicher Verein in Hamburg e.V. (2016), VVW Karlsruhe, 767 – 788.
- [110] New copulas based on general partitions-of-unity and their applications to risk management (with H. Awoumlac Tsatedem, A. Mändle and C. Girschig). Dependence Modeling (2016), 123 – 140.

2015

- [109] Some Extensions of Singular Mixture Copulas (with D. Lauterbach). In: M. Hallin, D. Mason, D. Pfeifer, J. Steinebach (Eds.): Mathematical Statistics and Limit Theorems - Festschrift in Honour of Paul Deheuvels, Springer (2015), Heidelberg, 271 - 286.
- [108] Katastrophenrisiken und Extremwerttheorie. In: W. Gleißner , F. Romeike (Hrsg.): Praxishandbuch Risikomanagement. Konzepte - Methoden - Umsetzung, 287 - 303, Erich Schmidt Verlag, Berlin (2015).

2014

- [107] From Bernstein polynomials to Bernstein copulas (with C. Cottin). Journal of Applied Functional Analysis (2014), 277 - 288.

2013

- [106] Singular mixture copulas (with D. Lauterbach). In: P. Jaworski, F. Durante, W.K. Härdle (Eds.): Copulae in Mathematical and Quantitative Finance. Proceedings of the Workshop Held in Cracow, 10-11 July 2012. Lecture Notes in Statistics 213, Springer (2013), Berlin, 165 - 175.
- [105] Correlation, tail dependence and diversification. In: C. Becker, R. Fried, S. Kuhnt (Hrsg.): Robustness and Complex Data Structures. Festschrift in Honour of Ursula Gather, 301 - 314, Springer, Berlin (2013).
- [104] How do you deal with operational risk? A survey of risk management practices in the German insurance sector (with J. Prokop). Journal of Risk Management in Financial Institutions 6, Number 4 (2013), 444 - 454.

2012

- [103] Ein Reservierungsverfahren für die Rechtsschutzversicherung (with S. Henniges, D. Straßburger and A. Winkel). Zeitschrift für die gesamte Versicherungswissenschaft (2012), 581 - 595.

- [102] Das Management des operationellen Risikos in Versicherungsunternehmen (mit J. Prokop). Marktstudie (in Kooperation mit Steria Mummert ISS), September 2012.

2011

- [101] Proposal for correction of the SCR calculation bias in Solvency II (with M. Hampel). Zeitschrift für die gesamte Versicherungswissenschaft (2011), 733 - 743.

2010

- [100] A probabilistic storm surge risk model for the German North and Baltic Sea coast (with J.-H. Grabbert, J. Deepen, A. Reiner, S. Mai, H. Rodda and A. Kortenhaus). Abstract published in: Geophysical Research Abstracts Vol. 12, EGU2010-14148, 2010. Poster: http://dr-smai.de/PDF_Poster/poster_egu_2010.pdf
- [99] Aktuarwissenschaften: Schaden-/Unfallversicherung. Lektion 6 des schriftlichen Management-Lehrgangs "Finanzmathematik" unter der fachlichen Leitung von M. Heinrich und R. Eller. EUROFORUM Verlag, Düsseldorf 2010, 85 S.

2009

- [98] Risikotheorie - wesentliche Grundlage für die Versicherungs- und Finanzmathematik. In: Deutsche Aktuarvereinigung (Hrsg.): Risiken kalkulierbar machen. Der Berufsstand der Aktuar. VVW Karlsruhe (2009), 73 - 78.
- [97] Modelling and simulation of dependence structures in nonlife insurance with Bernstein copulas (with D. Straßburger and J. Philipps). International ASTIN-Colloquium, June 1 - 4, 2009, Helsinki.

2008

- [96] Stochastische Differentialgleichungen für Finanzmarktmodelle (with D. Straßburger). In: Die Kunst des Modellierens: Mathematisch-Ökonomische Modelle. B. Luderer (Hrsg.), Teubner 2008, 351 - 359.
- [95] Solvency II: Stability problems with the SCR aggregation formula (with D. Straßburger). Scandinavian Actuarial Journal (2008). No. 1, 61 - 77

2007

- [94] Risikomanagement und Solvency II bei Versicherungsunternehmen. Marktstudie (mit L. Dorenkamp and P. Ott), in Kooperation mit KPMG Deutsche Treuhand-Gesellschaft Aktiengesellschaft Wirtschaftsprüfungsgesellschaft (2007).

2006

- [93] Strichlisten bei Laplace-Experimenten - zum Paradox der ungleichmäßigen Verteilung. Stochastik in der Schule 26 (2006), 23 - 27.

2005

- [92] Dependence matters! (with D. Straßburger). International ASTIN-Colloquium, ETH Zürich, September 4- 7, 2005, Switzerland.

2004

- [91] Modeling and generating dependent risk processes for IRM and DFA (with J. Neslehova). ASTIN Bulletin 34 (2004), 333 - 360.
- [90] Solvency II: neue Herausforderungen an Schadenmodellierung und Risikomanagement? In: Risikoforschung und Versicherung - Festschrift für Elmar Helten zum 65. Geburtstag, Verlag Versicherungswirtschaft (2004), 467 - 481.
- [89] Maximum Likelihood Estimators in a Statistical Model of Natural Catastrophe Claims with Trend (with A. Kukush and Y. Chernikov). Extremes 7 (2004), 309 - 336.

2003

- [88] On the distance between the distributions of random sums (with B. Roos). Journal of Applied Probability 40 (2003), 87 - 106.
- [87] On error bounds for the approximation of random sums (with B. Roos). International ASTIN Colloquium, Berlin, August 24 - 27 (2003).
- [86] Möglichkeiten und Grenzen der mathematischen Schadenmodellierung. Zeitschrift für die gesamte Versicherungswissenschaft, Heft 4 (2003), 667 - 696.
- [85] Modeling dependence in finance and insurance: the copula approach (with J. Neslehova). Blätter der DGVM Band XXVI, Heft 2 (2003), 177 - 191.
- [84] Teaching Stochastic Finance in a Multimedia Environment (with Ch. Mohn). Bulletin of the International Statistical Institute 54th Session, Contributed Papers, Volume LX, Book 2, S. 75-76 (2003).

2002

- [83] Size selection and competition for mussels *Mytilus edulis*, by oystercatchers, *Haematopus ostralegus*, herring gulls, *Larus argentatus*, and common eiders, *Somateria mollissima* (with G. Hilgerloh). Ophelia 56 (2002), 43-54.
- [82] e-stat: Basic Stochastic Finance at School Level (with Ch. Mohn). In: Proceedings in Computational Statistics, W. Härdle and B. Rönz (Hrsg.), CompStat 2002, Berlin, p. 321 - 326. Physika Verlag (2002)

2001

- [81] Wahldebakel: BUSH + GORE + CHAOS = RUEGE? Anmerkungen zu einer mathematischen Denksportaufgabe (with M. Naatz). *Stochastik in der Schule* 21 (2001), 9 - 13.
- [80] On an estimation problem for type I censored spatial Poisson processes (with J. Hurt and P. Lachout). *Kybernetika* 37 (2001), 103 - 108.
- [79] Study 4: Extreme value theory in actuarial consulting: windstorm losses in central Europe. In: R.-D. Reiss, M. Thomas: *Statistical Analysis of Extreme Values. With applications to insurance, finance, hydrology and other fields*. 2nd ed., Birkhäuser, Basel (2001), 373 - 378.

2000

- [78] A simple method to estimate parametric claim size distributions from grouped data (with J. Brix). *Blätter der Deutschen Gesellschaft für Versicherungsmathematik XXIV* (2000), 495 - 505.
- [77] Wissenschaftliches Consulting im Rückversicherungsgeschäft: Modelle, Erfahrungen, Entwicklungen. *Zeitschrift für Versicherungswesen* 21 (2000), 771 - 777.
- [76] Estimates for the Syracuse problem via a probabilistic model (with K. Borovkov). *Teorija Verovatnostej i ee Primenenija* 45 (2000), 386 - 395.
- [75] Zur Mathematik derivativer Finanzinstrumente: Anregungen für den Stochastik-Unterricht. *Stochastik in der Schule* 20 (2000), 25 - 37.
- [74] Zum Problem des Minimal-Areals in der Statistischen Ökologie. In: Ch. Hennig and D. Pfeifer (Hrsg.): *Datenanalyse und Numerische Klassifikation: Beiträge zur Herbsttagung der AG DA-NK der Gesellschaft für Klassifikation, Hamburg, 5.-6.11. 1999. Hamburger Beiträge zur Modellierung und Simulation, Heft 13* (2000).

1998

- [73] Risikotheoretische Konzepte unter Maple und Excel (with Ch. Hipp). *Der Aktuar* (1998), 4. Jahrgang, Heft 1, 11 - 17.
- [72] Statistical tools for monitoring benthic communities (with H.-P. Bäumer, R. Dekker and U. Schleier). *Senckenbergiana maritima* 29 (1998), 63 - 76.

1997

- [71] A statistical model to analyse natural catastrophe claims by means of record values. *Proceedings of the XXVIIIth International ASTIN Colloquium, Cairns, Australia, 1997*, 45 - 57.

- [70] Ökosystemforschung Niedersächsisches Wattenmeer - ELAWAT - Elastizität des Ökosystems Wattenmeer (Förderkennzeichen: 03F0112A). Abschlußbericht des Teilprojektes B2, Titel: Untersuchungen zu Reaktionen raum-zeitlicher Muster von Organismengemeinschaften im Watt auf Umwelteinflüsse: Beiträge der Angewandten Statistik zur Versuchsplanung, Durchführung und Auswertung.

1996

- [69] On asymptotic behavior of weighted sample quantiles (with K. Borovkov and H. Dehling). *Mathematical Methods of Statistics* 5 (1996), 173 - 186.
- [68] The zero utility principle for scale families of risk distributions (with B. Heidergott). *Blätter der Deutschen Gesellschaft für Versicherungs-mathematik XXII* (1996), 711 - 722.
- [67] The "Minimal Area" problem in ecology: a spatial Poisson process approach (with H.-P. Bäumer and U. Schleier). *Computational Statistics* 11 (1996), 415 - 428.
- [66] On improvements of the order of approximation in the Poisson limit theorem (with K. Borovkov). *Journal of Applied Probability* 33 (1996), 146 - 155.
- [65] Pseudo-Poisson approximation for Markov chains (with K. Borovkov). *Stochastic Processes and Their Applications* 61 (1996), 163 - 180.
- [64] Modeling spatial distributional patterns of benthic meiofauna species by Thomas and related processes (with H.-P. Bäumer, H. Ortleb, G. Sach and U. Schleier). *Ecological Modelling* 87 (1996), *Modelling of Geo-Biosphere Processes Section*, 285 - 294.
- [63] Modeling dynamics and spatial aggregation of biological populations by stochastic networks (with K. Borovkov and H.-P. Bäumer). *Senckenbergiana maritima* 27 (1996), 129 - 136.

1995

- [62] The index-of-dispersion test revisited (with H. Ortleb, U. Schleier-Langer and H.-P. Bäumer). In: W. Gaul, D. Pfeifer (Eds.): *From Data to Knowledge: Theoretical and Practical Aspects of Classification, Data Analysis and Knowledge Organization*, 1995, 270 - 277. Springer, N.Y.
- [61] On record indices and record times (with K. Borovkov). *Journal of Statistical Planning and Inference* 45 (1995), 65 - 79

1994

- [60] The analysis of spatial data from marine ecosystems (with U. Schleier-Langer and H.-P. Bäumer). In: H.-H. Bock, W. Lenski, and M.M Richter (Eds.): *Information Systems and Data Analysis. Prospects - Foundations - Applications. Studies in Classification, Data Analysis, and Knowledge Organization*, 1994, 340 - 349. Springer, N.Y.

- [59] Stochastic modeling of spatial dynamic patterns. Applications in ecology (with H.-P. Bäumer, H. Ortleb and U. Schleier-Langer). In: Dutter, R. and Grossmann, W. (Eds.) (1994): COMPSTAT. Proceedings in Computational Statistics. 11th Symposium, Vienna 1994. Physica-Verlag, Heidelberg, 120 - 125.

1993

- [58] A probabilistic variant of Chernoff's product formula. Semigroup Forum 46 (1993), 279 - 285.
- [57] Moving point patterns: the Poisson case (with H.-P. Bäumer and M. Albrecht). In: O. Opitz and B. Lausen (Eds.): Information and Classification: Concepts, Methods and Applications. Studies in Classification, Data Analysis, and Knowledge Organization, 1993, 248 - 257. Springer, N.Y.

1992

- [56] Unabhängige Ereignisse in diskreten Wahrscheinlichkeitsmodellen. Stochastik in der Schule 12 (1992), Nr. 2, 3 - 20.
- [55] Kettenbriefe - was sie versprechen, was sie halten. Stochastik in der Schule 12 (1992), Nr. 3, 37 - 47.
- [54] Räumliche Punktprozesse und ihre Anwendung in Biologie und Ökologie. In: D.P.F. Möller, O. Richter (Hrsg.): Fortschritte der Simulation in Medizin, Biologie und Ökologie. 5. Ebernburger Gespräch, Bad Münster am Stein, 26. - 28. März 1992. Informatik-Bericht 92/6 (1992), Technische Universität Clausthal-Zellerfeld, 23 - 34.
- [53] Spatial point processes and their applications to biology and ecology (with H.-P. Bäumer and M. Albrecht). Modeling of Geo-Biosphere Processes 1 (1992), 145 - 161.
- [52] Projekt B3: Beiträge der Angewandten Statistik zur Bearbeitung von Maßstabsfragen und zur Versuchsplanung für die Untersuchung räumlicher Strukturen und dynamischer Vorgänge im Watt (with H.-P. Bäumer and M. Albrecht). Wissenschaftliches Symposium Wattenmeer, 15.11. - 18.11.1992, Norderney (UBA-Bericht).

1991

- [51] Some remarks on Nevzorov's record model. Advances in Applied Probability (1991), 823 - 834.
- [50] Poisson approximations of image processes in computer tomography. In: H.-H. Bock, P. Ihm (Eds.): Classification, Data Analysis, and Knowledge Organization. Models and Methods with Applications. Studies in Classification, Data Analysis, and Knowledge Organization, 1991, 68 - 71. Springer, N.Y.

- [49] Tschernobyl und die Folgen aus der Sicht der Mathematik. Einblicke (1991): Forschung an der Universität Oldenburg, 31 - 34.

1990

- [48] Stochastik für Informatiker (with R. Mathar). Leitfäden und Monographien der Informatik, Teubner-Verlag, Stuttgart, 1990; 359 S. (Herausgeber: V. Claus, G. Hotz, K. Waldschmidt).

1989

- [47] Einführung in die Extremwertstatistik. Skripten zur Mathematischen Stochastik, Teubner-Verlag, Stuttgart, 1989; 199 S. (J. Lehn, N. Schmitz, W. Weil, Eds.).
- [46] Extremal processes, secretary problems and the $1/e$ -law. Journal of Applied Probability 26 (1989), 722 - 733.
- [45] A new semigroup technique in Poisson approximation (with P. Deheuvels and M.L. Puri). Semigroup Forum 38 (1989), 189 - 201.

1988

- [44] Poisson approximations of multinomial distributions and point processes (with P. Deheuvels). Journal of Multivariate Analysis 25 (1988), 65 - 89.
- [43] Poisson approximations in selected metrics by coupling and semigroup methods with applications (with P. Deheuvels, A.F. Karr and R.J. Serfling). Journal of Statistical Planning and Inference 20 (1988), 1 - 22.
- [42] On a relationship between Uspensky's theorem and Poisson approximations (with P. Deheuvels). Annals of the Institute of Statistical Mathematics 40 (1988), 671 - 681.
- [41] On a relationship between record times and record values of an i.i.d. sequence. Workshop on Extremes of Random Processes in Applied Probability, Santa Barbara 1987. In: Advances in Applied Probability 20 (1988), 12.

1987

- [40] Semigroups and Poisson approximation (with P. Deheuvels). In: New Perspectives in Theoretical and Applied Statistics (M.L. Puri, J.P. Vilaplana and W. Wertz. Eds.) Wiley, N.Y. 1987, 439 - 448.
- [39] On a joint strong approximation theorem for record and inter-record times. Theory of Probability and Related Fields 75 (1987), 213 - 221.
- [38] A note on stability of maxima and records of an iid sequence (with U. Gather). Publications de l'Institut de Statistique de l'Université Paris XXXII (1987), 71 - 79.

- [37] A survey on strong approximation techniques in connection with records (with Y.-S. Zhang). In: Extreme Value Theory. Proceedings, Oberwolfach. 1987, 50 - 58. Lecture Notes in Statistics 51, Springer, N.Y.
- [36] Strong approximations of records and record times by Poisson and Wiener processes. 16th Conference on Stochastic Processes and Their Applications, Stanford 1987. In: Stochastic Processes and Their Applications 26 (1987), 209.
- [35] A martingale characterization of mixed Poisson processes (with U. Heller). Journal of Applied Probability 24 (1987), 246 - 251.
- [34] Bemerkung zur Approximation von gemischten durch einfache Poisson-Prozesse. Blätter der Deutschen Gesellschaft für Versicherungsmathematik XVIII (1987), 73.
- [33] On the distance between mixed Poisson and Poisson distributions. Statistics & Decisions 5 (1987), 367 - 379.
- [32] Martingale characteristics of mixed Poisson processes. Blätter der Deutschen Gesellschaft für Versicherungsmathematik XVIII (1987), 107 - 110.
- [31] On a Poisson model for the simplex algorithm and the "secretary problem". 11. Symposium über Operations Research, Darmstadt 1986. In: Methods of Operations Research 57 (1987), 233 - 242.

1986

- [30] A semigroup approach to Poisson approximation (with P. Deheuvels). Annals of Probability 14 (1986), 663 - 676.
- [29] Some general probabilistic estimations for the rate of convergence in operator semigroup representations. Applicable Analysis 23 (1986), 111 - 118.
- [28] Operator semigroups and Poisson convergence in selected metrics (with P. Deheuvels). Semigroup Forum 34 (1986), 203 - 224.
- [27] Extremal processes, record times and strong approximation. Publications de l'Institute de Statistique de l'Université Paris XXXI (1986), 47 - 65.
- [26] Zur Approximation von gemischten durch einfache Poisson-Prozesse. Blätter der Deutschen Gesellschaft für Versicherungsmathematik XVII (1986), 429 - 433.
- [25] Pólya-Lundberg Process. In: Encyclopedia of Statistical Sciences, Vol. 7. Wiley, N.Y. 1986, 63 - 65

1985

- [24] Approximation-theoretic aspects of probabilistic representations for operator semigroups. Journal of Approximation Theory 43 (1985), 271 - 296.

- [23] Probabilistic concepts of approximation theory in connexion with operator semigroups. *Journal of Approximation Theory and Its Applications* 1 (1985), No. 4, 93 - 118.
- [22] A semigroup setting for distance measures in connexion with Poisson approximation. *Semigroup Forum* 31 (1985), 201 - 205.
- [21] Coupling methods in connection with Poisson process approximation. *Zeitschrift für Operations Research, Ser. A*, 29 (1985), 217 - 223.
- [20] On a relationship between record values and Ross's model of algorithm efficiency. *Advances in Applied Probability* 17 (1985), 470 - 471.
- [19] On the rate of convergence for some strong approximation theorems in extremal statistics. *European Meeting of Statisticians, Marburg 1984*. In: *Statistics & Decisions* (1985), Supp. Iss. No. 2, 99 - 103.
- [18] An average-case analysis for a continuous random search algorithm. *Advances in Applied Probability* 17 (1985), 231 - 233.

1984

- [17] *Stochastische Methoden in der Theorie der Halbgruppen linearer Operatoren*. Habilitationsschrift, RWTH Aachen 1984.
- [16] On a probabilistic representation theorem of operator semigroups with bounded generator. *Journal of Mathematical Research and Exposition* 4 (1984), No. 1, 79 - 81.
- [15] A note on probabilistic representations of operator semigroups. *Semigroup Forum* 28 (1984), 335 - 340.
- [14] Probabilistic representations of operator semigroups - a unifying approach. *Semigroup Forum* 30 (1984), 17 - 34.
- [13] Limit laws for inter-record times from non-homogeneous record values. *Journal of Organizational Behavior and Statistics* 1 (1984), 69 - 74.
- [12] A note on moments of certain record statistics. *Zeitschrift für Wahrscheinlichkeitstheorie und verwandte Gebiete* 66 (1984), 293 - 296.
- [11] A note on random time changes of Markov chains. *Scandinavian Actuarial Journal* (1984), 127 - 129.

1983

- [10] A semigroup-theoretic proof of Poisson's limit law. *Semigroup Forum* 26 (1983), 379 - 382.

[9] On the recursive generation of Markov chains. In: Transactions of the 9th Prague Conference on Information Theory, Statistical Decision Functions and Random Processes 1982. Academia (1983), 121 - 125.

[8] A note on the occurrence times of a Pólya-Lundberg process. Advances in Applied Probability 15 (1983), 886.

1982

[7] On a general probabilistic representation formula for semigroups of operators. Journal of Mathematical Research and Exposition 2 (1982), No. 4, 93 - 98.

[6] Characterizations of exponential distributions by independent non-stationary record increments. Journal of Applied Probability 19 (1982), 127 - 135, 906.

[5] The structure of elementary pure birth processes. Journal of Applied Probability 19 (1982), 664 - 667.

[4] An alternative proof of a limit theorem for the Pólya-Lundberg process. Scandinavian Actuarial Journal (1982), 176 - 178.

1981

[3] Asymptotic expansions for the mean and variance of logarithmic inter-record times. Methods of Operations Research 39 (1981), 113 - 121.

1980

[2] "Record Values" in einem stochastischen Modell mit nicht-identischen Verteilungen. Dissertation, RWTH Aachen 1980.

1978

[1] An application of record values to stochastic simulation. II. Symposium über Operations Research, RWTH Aachen 1977. In: Methods of Operations Research 29 (1978), 738 - 749.

Ausgewählte Vorträge

1. Gedanken zur Altersversorgung im Öffentlichen Dienst (2000)
2. VaR vs. Expected Shortfall. Risk Measures under Solvency II (2004)
3. Insurance Risk Management for catastrophic events (Cherry Bud Workshop, Yokohama, 2005)
4. Versicherungsmathematik in der Praxis: Verursacht der Klimawandel höhere Sturmrisiken? (Uni im Rathaus, RWTH Aachen 2008)
5. Derivate & Co (Mathematik für die Schule, 2011)
6. Können Risiken aus technisch-ökonomischen Entwicklungen zuverlässig eingeschätzt werden? Ein Diskussionsbeitrag aus Sicht der mathematischen Statistik (Lions Club Oldenburg, 2012)
7. Conference in Honor of Paul Deheuvels (Paris, 20.6 - 21.6.2013)
8. DAV vor Ort (Hamburg, 4.12.2013)
9. Tagung der Fachschaft Mathematik/Informatik des Cusanuswerks "Mathematik von Naturkatastrophen" (Eichsfeld, 28.5. – 1.6.2014)
10. Zweiter Weiterbildungstag der DGVM (Hannover, 21.5.2015)
11. Tag der Mathematik (8.9.2016)
12. Abschiedsvorlesung. Sommersemester 2016, Universität Oldenburg
13. Challenges of applying a consistent Solvency II framework. EIOPA Advanced Seminar: Quantitative Techniques in Financial Stability. 8-9 December 2016, Frankfurt
14. Data driven partition-of-unity copulas with applications to risk management. CEQURA Conference on Advances in Financial and Insurance Risk Management, Sept. 25 - 26, 2017, Munich
15. Partitions-of-Unity Copulas mit Anwendungen im Risikomanagement. Nachwuchsworkshop für junge Mathematiker, Tagungsstätte Loccum, 10. – 12.10.2019
16. Model Validation with Q-Q-Plots under Solvency II. CEQURA Conference on Advances in Financial and Insurance Risk Management Sept. 25, 2020, Munich
17. The European way to sustainable insurance - the ESG Challenge. Keynote Speech, ASTIN Online Colloquium May 2021
18. Generating unfavourable VaR scenarios with patchwork copulas. CEQURA Conference on Advances in Financial and Insurance Risk Management Sept. 24, 2021, Munich
19. A note on the estimation and simulation of distributions with Bernstein polynomials. CEQURA Conference on Advances in Financial and Insurance Risk Management, Oct. 7, 2022, Munich
20. Monte Carlo Methoden. vfvf-Mittagsseminar: Konzepte der Versicherungsmathematik einfach erklärt. Universität Oldenburg, 18.6.2024

Eigene musikalische Werke

Trio für zwei Violinen und Piano (1967 / 2021)

Memories (1969 / 2021)

Dreams (1969 / 2021)

Sonate für Violine und Klavier (1968 / 2021)

1. Satz, e-moll
2. Satz, D-Dur
3. Satz, A-Dur
4. Satz, e-moll

Fuga legata (1969 / 2021)

Sonatine für Klavier (1980)

Sommer 2020

Violinsonatine (Erweiterung der Sonatine für Klavier, 1990)

Klaviertrio (Erweiterung der Violinsonatine, 2020)

Flötenquartett (Arrangement des Klaviertrios, 2021)

Menuett (2022)

Quelle: https://imslp.org/wiki/Category:Pfeifer%2C_Dietmar