

# Wolfgang-Wetzel-Preis 2017

# Wolfgang-Wetzel-Preis

- Förderung herausragender Nachwuchswissenschaftler\*innen (bis fünf Jahre nach der Promotion)
- Ausgezeichnet wird ein herausragender Beitrag zur statistischen Methodik und ihrer Anwendung
- Vergabe einmal jährlich im Rahmen der Statistischen Woche
- Vorschlag durch Mitglieder der Deutschen Statistischen Gesellschaft
- Auswahl durch ein dreiköpfiges Gremium
- Preisgeld wird durch den Springer Verlag übernommen

# Wolfgang Wetzel



- \*12.10.1921, †22.20.2004
- Promotion (1953) und Habilitation (1958) an der FU Berlin
- Professuren in Kiel (1960-1965, 1971-1987) und an der FU Berlin (1965-1971)
- Forschungsschwerpunkte: Zeitreihenanalyse, Stichprobentheorie und Unternehmensforschung
- Vorsitzender der DStatG von 1972 bis 1976
- Setzte sich in seiner Amtszeit vor allem für die Stärkung der mathematisch-statistischen Methoden ein
- Ehrenmitglied der DStatG seit 1978

# Frühere Preisträger\*innen

- 2011: Jörg Drechsler
- 2012: Sonja Greven
- 2013: Dominik Wied
- 2014: Hans Manner
- 2015: Nadja Klein
- 2016: Heiko Grönitz
- 2017: ??

# Simulationsbasierte Verfahren

Approximative statistische Inferenz für Probleme in denen

- der datengenerierende Prozess keine expliziten Herleitungen erlaubt,
- aber selbst einfach simuliert werden kann.

# Modellierung und Prognose von Finanzmarktrisiken

Zunehmende Verfügbarkeit hochfrequenter Finanzmarktdaten und damit neue Herausforderungen in Modellierung und Prognose.

- Schätzung von Volatilitäten und Kovolatilitäten.
- Mischung hoch- und niederfrequenter Informationsquellen.

# Dr. Roxana Halbleib

- Master International Business Economics (Universität Konstanz) & Diploma in Economics (University of Jassy)
- 2010 Promotion in VWL mit Schwerpunkt Ökonometrie (Betreuer: Winfried Pohlmeier) an der Universität Konstanz
- Postdoc an der Universität Konstanz seit 2010 (Margarete von Wrangel Habilitationstipendiatin)



# Publikationen (Auswahl)

- Estimating GARCH-type Models with Symmetric Stable Innovations: Indirect Inference versus Maximum Likelihood (mit G. Calzolari & A. Parrini, 2014, Computational Statistics & Data Analysis)
  - Schätzung von GARCH-Modellen mit alpha-stabilen Fehlern über simulationsbasierte Inferenz
- Estimating Stable Latent Factor Models by Indirect Inference, (mit G. Calzolari, 2016, Journal of Econometrics)
  - Erklärung des gemeinsamen Volatilitätsverhaltens durch latente Faktorenmodelle mit alpha-stabilen Faktoren
- Which Model to Match? (mit M. Barigozzi & D. Veredas, 2015)
  - Entwicklung eines Informationskriteriums zur Auswahl des besten Hilfsmodells zur Durchführung der simulationsbasierten Inferenz



# Publikationen (Auswahl)

- Modelling and Forecasting Multivariate Realized Volatility (mit V. Voev, 2011, Journal of Applied Econometrics)
  - Schätzung großer Kovarianzmatrizen aus hochfrequenten Zeitreihen über Cholesky-Faktoren
- Forecasting Multivariate Volatility using the VARFIMA Model on Realized Covariance Cholesky Factors (mit V. Voev, 2011, Journal of Economics and Statistics)
  - Vergleich mit alternativen Modellspezifikationen

Wolfgang-Wetzel-Preis

2017:

Dr. Roxana Halbleib