

# **Wolfgang-Wetzel-Preis der DStatG**

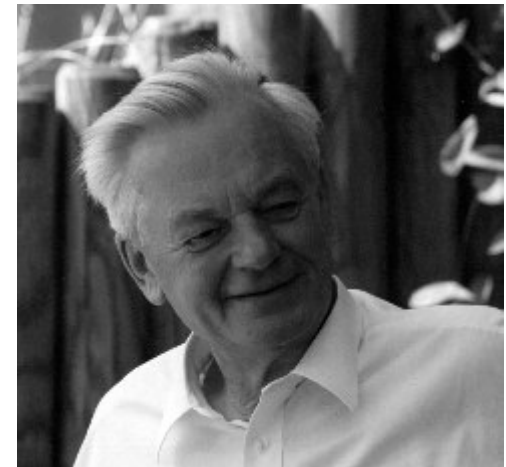
Zur Förderung herausragender  
Nachwuchswissenschaftlerinnen und  
Nachwuchswissenschaftler

# Wolfgang-Wetzel-Preis

- Der Preis richtet sich an Nachwuchswissenschaftler bis **maximal fünf Jahre** nach der Promotion.
- Ausgezeichnet wird ein herausragender Beitrag zur **statistischen Methodik und ihrer Anwendung**.
- Möglich ist auch die Auszeichnung mehrerer Publikationen, die mit unterschiedlichen Koautoren verfasst worden sind.

# Wolfgang Wetzel

- 1972 bis 1976 Vorsitzender der Deutschen Statistischen Gesellschaft
- Ehrenmitglied seit 1978
- **1994 Ehrenpromotion an der FU Berlin**



1921 - 2004

„für seine grundlegenden Beiträge zur Quantifizierung der Wirtschaftswissenschaft, für seine richtungsweisenden Arbeiten auf dem Gebiet der Zeitreihenanalyse und als Wegbereiter der Computational Statistics.“

Die DStatG verleiht den

**Wolfgang-Wetzel-Preis 2014**

an

**Hans Manner**



# Hans Manner

- geboren 1980
- 2005: Master of Econometrics  
Universität Maastricht
- 2010 Promotion in Ökonometrie  
Universität Maastricht
- seit 2010 Juniorprofessor  
Universität zu Köln

# Hans Manner

## Forschungsinteressen

- Multivariate Zeitreihenanalyse
- Modellierung von Risiken / extremen Ereignissen
- Anwendungen insb. auf Finanz- und Energiemärkte aber auch Verkehrsunfälle

# Wichtige Publikationen

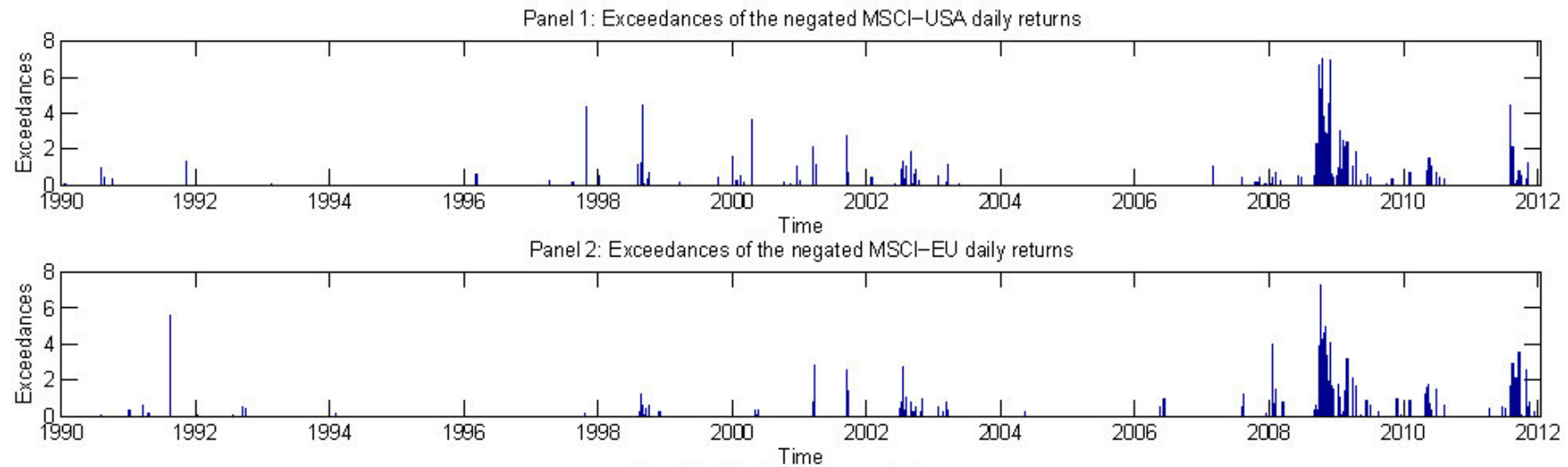
- Modeling Multivariate Extreme Events Using Self-Exciting Point Processes (mit O. Grothe and V. Korniichuk),  
*Journal of Econometrics*
- Dynamic Stochastic Copula Models: Estimation, Inference and Applications (mit C. Hafner)  
*Journal of Applied Econometrics* 2012.
- Tails of correlation mixtures of elliptical copulas (mit J. Segers)  
*Insurance: Mathematics and Economics* 2011.

# Wichtige Publikationen

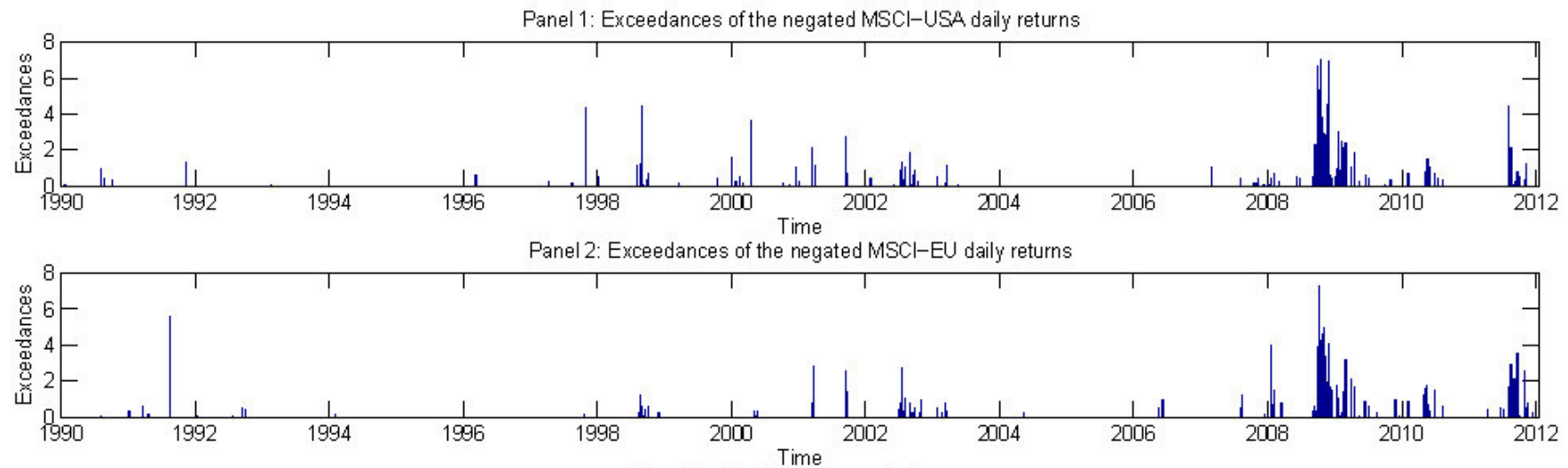
- Modeling Multivariate Extreme Events Using Self-Exciting Point Processes (mit O. Grothe and V. Korniichuk),  
*Journal of Econometrics*
- Dynamic Stochastic Copula Models: Estimation, Inference and Applications (mit C. Hafner)  
*Journal of Applied Econometrics* 2012.
- Tails of correlation mixtures of elliptical copulas (mit J. Segers)  
*Insurance: Mathematics and Economics* 2011.



# Überschreitungen der 97,7% Quantile



Extreme negative Realisationen amerikanischer  
und europäischer Kapitalmarktrenditen



- $\text{Prob}(\text{„mindestens eine Zeitreihe überschreitet den Schwellwert“})$
- Auftreten extremer Ereignisse  
→ selbsterregende Prozesse
- Multivariater Prozess:  
→ Extremwertcopula

# **Wolfgang-Wetzel-Preis 2014**

## **an Hans Manner**

Wolfgang Wetzel „ging von einer substanzwissenschaftlichen Frage aus, für die eine geeignete mathematische Lösung gesucht wird. Er legte großen Wert auf eine exakte und vollständige Darstellung des mathematischen Ansatzes, wie zum Beispiel auf die Analyse der Existenz von Lösungen. Sorgfältig wurde auch die Frage nach geeigneten Algorithmen behandelt.“

Gerd Hansen in „Wolfgang Wetzel in memoriam“

Die DStatG verleiht den

**Wolfgang-Wetzel-Preis 2014**

an

**Hans Manner**

