

Univ.-Prof. Dr. Gabriel Frahm



Dienstanschrift:

Helmut-Schmidt-Universität /
Universität der Bundeswehr Hamburg
Holstenhofweg 85
22043 Hamburg

Kontakt:

Tel.: +49-(0)40 6541-2791
Fax: +49-(0)40 6541-2023
Mail: frahm@hsu-hh.de
Internet: <http://www.hsu-hh.de/stochastik>

**Rolle und Lehrgebiete
im MBA-
Fernstudienprogramm:**

Dozent für die folgende Kurseinheit:
• Enterprise Risk Management (A 012)

**Akademischer
Werdegang:**

1993 – 1999

Studium der BWL an der Universität zu Köln

1999 – 2000

wissenschaftlicher Mitarbeiter am Lehrstuhl für
Finanzierungslehre an der Universität zu Köln

2004

Promotion in Statistik an der Universität zu Köln

2005 – 2009

wissenschaftlicher Mitarbeiter sowie akademischer Rat auf Zeit
am Lehrstuhl für Statistik und Ökonometrie an der Universität zu
Köln

2009

Venia Legendi (Privatdozent) für Statistik und Ökonometrie an
der Universität zu Köln

2010

Vertretung des Lehrstuhls für Ökonometrie und empirische
Wirtschaftsforschung an der Universität Münster

2010 – 2012

Vertretung des Lehrstuhls für Angewandte Stochastik an der Helmut-Schmidt-Universität

2012

Berufung auf den Lehrstuhl für Angewandte Stochastik und Risikomanagement an der Helmut-Schmidt-Universität

Beruflicher Werdegang:

2000 – 2002

interner Berater der Stabsabteilung Mathematik/OR der WestLB in Düsseldorf

2002 – 2004

Forscher in der AG Financial Engineering im Center of Advanced European Studies and Research in Bonn

2005

Forscher in der AG Financial Mathematics der NEC Laboratories in Sankt Augustin

Derzeitige berufliche Tätigkeit:

Inhaber des Lehrstuhls für Angewandte Stochastik und Risikomanagement an der Helmut-Schmidt-Universität

Veröffentlichungen:

Frahm, G. (2016): Pricing and Valuation under the Real-World Measure, International Journal of Theoretical and Applied Finance 19, DOI: 10.1142/S0219024916500060.

Frahm, G. und Jaekel, U. (2015): Tyler's M-Estimator in High-Dimensional Financial-Data Analysis, Modern Nonparametric, Robust and Multivariate Methods, Kapitel 17, 289-305, Springer.

Frahm, G. (2015): A Theoretical Foundation of Portfolio Resampling, Theory and Decision 79, 107-132.

Dobric, J., Frahm, G. und Schmid, F. (2013): Dependence of Stock Returns in Bull and Bear Markets, Dependence Modeling 1, 94-110, DOI:10.2478/demo-2013-0005.

Frahm, G. und Wiechers, C. (2013): A Diversification Measure for Portfolios of Risky Assets, Advances in Financial Risk Management, 312-330, Palgrave Macmillan.

Frahm, G., Wickern, T. und Wiechers, C. (2012): Multiple Tests for the Performance of Different Investment Strategies, Advances in Statistical Analysis 96, 343-383.

Frahm, G. und Glombek, K. (2012): The Semicircle Law of Tyler's M-Estimator for Scatter, Statistics and Probability Letters 82, 959-964.

Frahm, G. und Memmel, C. (2010): Dominating Estimators for Minimum-Variance Portfolios, *Journal of Econometrics* 159, 289-302.

Frahm, G. und Jaekel, U. (2010): A Generalization of Tyler's M-Estimators to the Case of Incomplete Data, *Computational Statistics and Data Analysis* 54, 374-393.

Frahm, G. (2009): Asymptotic Distributions of Robust Shape Matrices and Scales, *Journal of Multivariate Analysis* 100, 1329-1337.

Bade, A., Frahm, G. und Jaekel, U. (2009): A General Approach to Bayesian Portfolio Optimization, *Mathematical Methods of Operations Research* 70, 337-356.

Frahm, G. (2008): Linear Statistical Inference for Global and Local Minimum Variance Portfolios, *Statistical Papers* 51, 789-812.

Frahm, G. (2006): On the Extremal Dependence Coefficient of Multivariate Distributions, *Statistics and Probability Letters* 76, 1470-1481.

Frahm, G., Junker, M. und Schmidt, R. (2005): Estimating the Tail-Dependence Coefficient: Properties and Pitfalls, *Insurance: Mathematics and Economics* 37, 80-100.

Frahm, G., Junker, M. und Szimayer, A. (2003): Elliptical Copulas: Applicability and Limitations, *Statistics and Probability Letters* 63, 275-286.