

Curriculum Vitae



Univ.-Prof. Dr. Gabriel Frahm,
*** 21.03.1972**

Dienstlich:

Helmut-Schmidt-Universität
Universität der Bundeswehr Hamburg
Fakultät für Wirtschafts- und Sozialwissenschaften
Fächergruppe Mathematik/Statistik
Lehrstuhl für Angewandte Stochastik und
Risikomanagement

Holstenhofweg 85
22043 Hamburg

Tel.: 040 6541-2791
E-Mail: frahm@hsu-hh.de
URL: www.hsu-hh.de/stochastik

Privat:

Wilhelm-Raabe-Weg 15g
21244 Buchholz i. d. N.

Tel.: 04181 9289974 (Festnetz)
01577 7335182 (mobil)
E-Mail: gabrielfracm@gmail.com

Akademischer Werdegang

04/2005 – 05/2009	Habitationsort: Universität zu Köln Habilitationsschrift: <i>Advanced Methods of Multivariate Financial Data Analysis</i> Gutachter: 1. Prof. Dr. Karl Mosler 2. Prof. Dr. Friedrich Schmid Abschluss: Venia Legendi in Statistik & Ökonometrie
04/2002 – 07/2004	Promotionsort: Universität zu Köln Doktorarbeit: <i>Generalized Elliptical Distributions: Theory and Applications</i> Gutachter: 1. Prof. Dr. Friedrich Schmid 2. Prof. Dr. Karl Mosler Note: Summa Cum Laude Abschluss: Dr. rer. pol.
10/1993 – 11/1999	Studienort: Universität zu Köln Studiengang: Betriebswirtschaftslehre Diplomarbeit: <i>Ermittlung des Value-at-Risk von Finanzportefeuilles mit Methoden der Extremwerttheorie</i> Note: 1.0 Abschluss: Dipl.-Kfm. (Prädikatsexamen)

Berufliche Laufbahn

08/2012 – dato	Hochschule: Helmut-Schmidt-Universität Lehrstuhl: Angewandte Stochastik und Risikomanagement Position: Universitätsprofessor auf Lebenszeit (W3)
10/2010 – 07/2012	Hochschule: Helmut-Schmidt-Universität Lehrstuhl: Angewandte Stochastik Position: Vertretungsprofessor (W3)
07/2010 – 09/2010	Hochschule: Universität zu Köln Lehrstuhl: Statistik & Ökonometrie Position: Akademischer Rat auf Zeit
04/2010 – 06/2010	Hochschule: Universität Münster Lehrstuhl: Ökonometrie & empirische Wirtschaftsforschung Position: Vertretungsprofessor (W3)
08/2007 – 03/2010	Arbeitgeber: Universität zu Köln Lehrstuhl: Statistik & Ökonometrie Position: Akademischer Rat auf Zeit
04/2005 – 07/2007	Arbeitgeber: Universität zu Köln Lehrstuhl: Statistik & Ökonometrie Position: Wissenschaftlicher Mitarbeiter

01/2005 – 03/2005	Arbeitgeber:	NEC Laboratories Europe, NEC Europe Ltd., Sankt Augustin
	Arbeitsgruppe:	Finanzmathematik
	Position:	Forscher
02/2002 – 12/2004	Arbeitgeber:	Center of Advanced European Studies and Research, Bonn
	Arbeitsgruppe:	Financial Engineering
	Position:	Forscher
06/2000 – 02/2002	Arbeitgeber:	WestLB AG, Düsseldorf
	Geschäftsbereich:	Mathematik/OR
	Position:	Interner Berater
11/1999 – 05/2000	Arbeitgeber:	Universität zu Köln
	Lehrstuhl:	Allgemeine BWL und Finanzierungslehre
	Position:	Wissenschaftlicher Mitarbeiter

Preise und Auszeichnungen

2005 – 2010	Sechs Publikationspreise der Universität zu Köln.
2008	Beste Gesamtbeurteilung von den Studenten der Wirtschafts- und Sozialwissenschaftlichen Fakultät unter allen Dozenten des Fachbereichs Statistik.

Eingeworbene Drittmittel

2004	Arbeitgeber:	Center of Advanced European Studies and Research, Bonn
	Drittmittelgeber:	C&C Research Laboratories, NEC Europe Ltd., Sankt Augustin
	Projekt:	Financial Risk Management
	Mittelzufluss:	80000 €

Publikationen

2016	<i>Pricing and Valuation under the Real-World Measure</i> , International Journal of Theoretical and Applied Finance 19 , DOI: 10.1142/S0219024916500060.
2015	<i>Tyler's M-Estimator in High-Dimensional Financial-Data Analysis</i> (mit U. Jaekel), Modern Nonparametric, Robust and Multivariate Methods, Kapitel 17, Springer, 289–305.
2015	<i>A Theoretical Foundation of Portfolio Resampling</i> , Theory and Decision 79 , 107–132.
2013	<i>Dependence of Stock Returns in Bull and Bear Markets</i> (mit J. Dobrić und F. Schmid), Dependence Modeling 1 , 94–110.

- 2013 *A Diversification Measure for Portfolios of Risky Assets* (mit C. Wiechers), *Advances in Financial Risk Management*, Palgrave Macmillan, 312–330.
- 2012 *Multiple Tests for the Performance of Different Investment Strategies* (mit T. Wickern und C. Wiechers), *Advances in Statistical Analysis* **96**, 343–383.
- 2012 *The Semicircle Law of Tyler's M-Estimator for Scatter* (mit K. Glombek), *Statistics and Probability Letters* **82**, 959–964.
- 2010 *Dominating Estimators for Minimum-Variance Portfolios* (mit C. Memmel), *Journal of Econometrics* **159**, 289–302.
- 2010 *A Generalization of Tyler's M-Estimators to the Case of Incomplete Data* (mit U. Jaekel), *Computational Statistics and Data Analysis* **54**, 374–393. Publikationspreis der Universität zu Köln.
- 2009 *Asymptotic Distributions of Robust Shape Matrices and Scales*, *Journal of Multivariate Analysis* **100**, 1329–1337. Publikationspreis der Universität zu Köln.
- 2009 *A General Approach to Bayesian Portfolio Optimization* (mit A. Bade und U. Jaekel), *Mathematical Methods of Operations Research* **70**, 337–356. Publikationspreis der Universität zu Köln.
- 2008 *Linear Statistical Inference for Global and Local Minimum Variance Portfolios*, *Statistical Papers* **51**, 789–812. Publikationspreis der Universität zu Köln.
- 2006 *On the Extremal Dependence Coefficient of Multivariate Distributions*, *Statistics and Probability Letters* **76**, 1470–1481. Publikationspreis der Universität zu Köln.
- 2005 *Estimating the Tail-Dependence Coefficient: Properties and Pitfalls* (mit M. Junker und R. Schmidt), *Insurance: Mathematics and Economics* **37**, 80–100. Publikationspreis der Universität zu Köln.
- 2003 *Elliptical Copulas: Applicability and Limitations* (mit M. Junker und A. Szimayer), *Statistics and Probability Letters* **63**, 275–286.

Lehrveranstaltungen

- HT 2017 Spiel- und Entscheidungstheorie, Vorlesungen & Übungen
- FT 2017 Finanz- und Versicherungsmathematik, Vorlesungen & Übungen
- WT 2016 Quantitatives Risikomanagement, Vorlesungen & Übungen
- WT 2015 Simulation und Prognoseverfahren, Vorlesungen & Übungen
- HT 2014 Spiel- und Entscheidungstheorie, Vorlesungen & Übungen
- FT 2014 Finanz- und Versicherungsmathematik, Vorlesungen & Übungen
- WT 2014 Simulation und Prognoseverfahren, Vorlesungen & Übungen

HT 2013	Spiel- und Entscheidungstheorie, Vorlesungen & Übungen
FT 2013	Finanz- und Versicherungsmathematik, Vorlesungen & Übungen
WT 2013	Statistik I, Vorlesungen Simulation und Prognoseverfahren, Vorlesungen & Übungen
HT 2012	Spiel- und Entscheidungstheorie, Vorlesungen & Übungen
FT 2012	Finanz- und Versicherungsmathematik, Vorlesungen & Übungen
WT 2012	Simulation und Prognoseverfahren, Vorlesungen & Übungen
HT 2011	Spiel- und Entscheidungstheorie, Vorlesungen & Übungen
FT 2011	Finanz- und Versicherungsmathematik, Vorlesungen & Übungen
WT 2011	Ökonometrie, Vorlesungen & Übungen
HT 2010	Mathematik I, Vorlesungen Spiel- und Entscheidungstheorie, Vorlesungen & Übungen
WS 2010/11	Time Series Analysis (auf Englisch), Vorlesungen
SS 2010	Panel Data Analysis, Vorlesungen Advanced Statistics, Vorlesungen Induktive Statistik, Vorlesungen
WS 2009/10	Ökonometrie, Vorlesungen
SS 2009	Advanced Econometrics (auf Englisch), Vorlesungen & Übungen Deskriptive Statistik, Übungen
WS 2008/09	Einführung in die Ökonometrie, Übungen Induktive Statistik, Übungen
SS 2008	Time Series Analysis (auf Englisch), Übungen Deskriptive Statistik, Übungen Econometrics Crash Course (auf Englisch) für das Kölner Graduiertenkolleg Risk Management
WS 2007/08	Econometrics (auf Englisch), Übungen Induktive Statistik, Übungen
SS 2007	Time Series Analysis (auf Englisch), Übungen Deskriptive Statistik, Übungen
WS 2006/07	Deskriptive Statistik, Vorlesungen Econometrics (auf Englisch), Übungen
SS 2006	Time Series Analysis (auf Englisch), Vorlesungen & Übungen Econometrics Crash Course (auf Englisch) für das Kölner Graduiertenkolleg Risk Management

Gastaufenthalte

09/2012	Ort:	University of Tampere, Finland Tampere School of Public Health
	Gastgeber:	Prof. Dr. Hannu Oja
09/2010	Ort:	University of Tampere, Finland Tampere School of Public Health
	Gastgeber:	Prof. Dr. Hannu Oja

Gutachten

2016	Journal of Risk
2015	Festschrift für Hannu Oja
2014	Annals of Statistics
2014	Bernoulli
2013	The Journal of Risk
2012	Computational Statistics and Data Analysis
2012	Computational Statistics
2010	Advances in Statistical Analysis
2010	Extremes
2009	Statistics and Probability Letters
2008	Advances in Statistical Analysis
2008	Journal of Applied Statistics
2008	Econometrics Journal
2007	Sammelband: <i>Computational Methods in Financial Engineering</i> (Springer)
2007	Journal of Multivariate Analysis
2006	Brazilian Review of Econometrics
2004	ASTIN Bulletin

Buchholz i. d. N., 08.11.2017

