

## 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](mailto:frahm@hsu-hh.de)  
Internet: <http://www.hsu-hh.de/stochastik>
- Rolle und Lehrgebiete  
im MBA-  
Fernstudienprogramm:** Dozent in der Vertiefungsrichtung [Financial Risk  
Management](#) für die folgende Kurseinheit:
- Enterprise Risk Management (FRM 41):
    - Enterprise Risk Management
- 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.