

## Kurzlebenslauf

### Qualifikationen

Mathematik, Habilitation, Technische Universität München  
Datum der Bewilligung: 20 Jan. 2016

Mathematik, Promotion, Technische Universität Braunschweig  
Datum der Bewilligung: 31 März 2011

Mathematik, Diplom, Technische Universität Braunschweig  
Datum der Bewilligung: 31 Juli 2007

### Organisationszugehörigkeiten

#### Professur

Wissenschaftliches Personal  
Professur für Angewandte Stochastik  
Technische Universität Dresden  
1 Sep. 2016 → present

#### Professor:in

Otto von Guericke University Magdeburg  
Magdeburg, Deutschland  
1 Apr. 2016 → 31 Aug. 2016

#### Gastprofessor:in

Technische Universität Dresden  
Dresden, Deutschland  
1 Okt. 2013 → 30 Sep. 2014

#### PostDoc

Technische Universität München  
Garching bei München, Deutschland  
1 Juni 2012 → 31 März 2016

#### Gastprofessor:in

Michigan State University  
USA/Vereinigte Staaten  
1 Aug. 2011 → 31 Mai 2012

#### Doktorand:in

Technische Universität Braunschweig  
Braunschweig, Deutschland  
1 Apr. 2008 → 31 Juli 2011

#### Wissenschaftliche:r Mitarbeiter:in

Technische Universität Braunschweig  
Braunschweig, Deutschland  
1 Sep. 2007 → 31 März 2008

### Publikationen

#### On $q$ -scale functions of spectrally negative Lévy processes

Behme, A. D., Oechsler, D. C. & Schilling, R. L., 2 März 2023, in: Advances in Applied Probability. 55, 1, S. 56 - 84 29 S.

### **Moments of the Ruin Time in a Lévy Risk Model**

Strietzel, P. L. & Behme, A. D., Dez. 2022, in: Methodology and Computing in Applied Probability. 24, 4, S. 3075-3099 25 S.

### **Markov-modulated generalized Ornstein-Uhlenbeck processes and an application in risk theory**

Behme, A. D. & Sideris, A., Mai 2022, in: Bernoulli : official journal of the Bernoulli Society for Mathematical Statistics and Probability. 28, 2, S. 1309–1339 31 S.

### **On moments of downward passage times for spectrally negative Lévy processes**

Behme, A. D. & Strietzel, P. L., 2022, (Elektronische Veröffentlichung vor Drucklegung) in: Journal of Applied Probability.

### **A 2 x 2 random switching model and its dual risk model**

Behme, A. D. & Strietzel, P. L., 2021, in: Queueing Systems: Theory and Applications. 99, S. 27–64

### **Continuity properties and the support of killed exponential functionals**

Behme, A. D., Lindner, A., Reker, J. & Rivero, V., 2021, in: Stochastic Processes and their Applications. 140, S. 115–146

### **On the law of killed exponential functionals**

Behme, A. D., Lindner, A. & Reker, J., 2021, in: Electronic Journal of Probability. 26, 60, S. 1-35

### **Exponential functionals of Markov additive processes**

Behme, A. D. & Sideris, A., 2020, in: Electronic Journal of Probability. 25, 37, S. 1-25

### **Ruin probabilities for risk processes in a bipartite network**

Behme, A. D., Klüppelberg, C. & Reinert, G., 2020, in: Stochastic models : affiliated publication of the Institute for Operations Research and the Management Sciences. 36, S. 548-573

### **Exponential Functionals of Lévy Processes with Jumps**

Behme, A. D., 18 Apr. 2015, in: Alea : Latin American journal of probability and mathematical statistics. 12, S. 375-397

### **A criterion for invariant measures of Itô processes based on the symbol**

Behme, A. & Schnurr, A., 2015, in: Bernoulli : official journal of the Bernoulli Society for Mathematical Statistics and Probability. 21, 3, S. 1697-1718

### **Superposition of COGARCH processes**

Behme, A., Chong, C. & Klüppelberg, C., 2015, in: Stochastic processes and their applications. 125, S. 1426-1469

### **Asymmetric COGARCH processes**

Behme, A., Klüppelberg, C. & Mayr, K., 2014, in: Journal of Applied Probability. 51, A, S. 161-173

### **Distributions of exponential integrals of independent increment processes related to generalized gamma convolutions**

Behme, A., Maejima, M., Matsui, M. & Sakuma, N., 2012, in: Bernoulli : official journal of the Bernoulli Society for Mathematical Statistics and Probability. 18, 4, S. 1172-1187

### **Moments of MGOU processes and positive semidefinite matrix processes**

Behme, A., 2012, in: Journal of Multivariate Analysis. 111, S. 183-197

### **Multivariate generalized Ornstein-Uhlenbeck processes**

Behme, A. & Lindner, A., 2012, in: Stochastic processes and their applications. 122, S. 1487-1518

**Distributional properties of solutions of  $dV_t = V_{t-}dU_t + dL_t$  with Lévy noise**

Behme, A., 2011, in: Advances in Applied Probability. 43, 3, S. 688-711

**Stationary solutions of the stochastic differential equation  $dV_t = V_{t-}dU_t + dL_t$  with Lévy noise**

Behme, A., Lindner, A. & Maller, R., 2011, in: Stochastic processes and their applications. 121, S. 91-108