

## Doç. Dr. AZİZE HAYFAVİ

### Kişisel Bilgiler

İş Telefonu: [+90 312 210 5613](tel:+903122105613)

E-posta: [azizeh@metu.edu.tr](mailto:azizeh@metu.edu.tr)

Web: <https://avesis.metu.edu.tr/azizeh>

### Araştırma Alanları

Matematik, Çok Değişkenli Karmaşık Fonksiyonlar ve analitik uzaylar, Karmaşık Değişkenli Fonksiyonlar, Olasılık Kuramı, Stokastik Süreçler, Temel Bilimler

### Akademik Unvanlar / Görevler

Doç. Dr., Orta Doğu Teknik Üniversitesi, Uygulamalı Matematik Enstitüsü, Finansal Matematik Anabilim Dalı, 2002 - Devam Ediyor

Dr. Öğr. Üyesi, Orta Doğu Teknik Üniversitesi, Fen Edebiyat Fakültesi, Matematik Bölümü, 1964 - 2003

### Yönetilen Tezler

HAYFAVİ A., Bir bant içerisinde hareket eden faizlerin modellenmesi., Doktora, Ö.Özel(Öğrenci), 2018

HAYFAVİ A., Sıcaklığın modellenmesi ve sıcaklığa dayalı iklim türevlerinin fiyatlandırılması., Doktora, B.Taştan(Öğrenci), 2016

HAYFAVİ A., Hava sıcaklığı için rejim değişim modeli ve hava durumu türevlerinin fiyatlaması., Doktora, A.Türkvatan(Öğrenci), 2016

HAYFAVİ A., Teminatlı borç yükümlülükleri için korelasyon yapısının modellenmesi ve buna temel teşkil eden kredi temerrüt takası prim denklemlerinin belirlenmesi., Doktora, D.İlalan(Öğrenci), 2015

HAYFAVİ A., Zaman değiştirilmiş bir Lévy süreci için parçacık markov zinciri monte carlo yaklaşımı., Doktora, A.Yüksel(Öğrenci), 2015

YOLCU OKUR Y., HAYFAVİ A., Sıçrama süreçlerinin varlığında geriye doğru stokastik diferansiyel denklemler ve Feynman-Kac formülü., Yüksek Lisans, C.İncegöl(Öğrenci), 2013

YOLCU OKUR Y., HAYFAVİ A., Geriye doğru stokastik diferansiyel denklemler ve stokastik kontrol problemlerine uygulanması., Yüksek Lisans, H.Sevda(Öğrenci), 2013

HAYFAVİ A., Elektrik piyasalarının stokastik modellenmesi., Doktora, İ.Talaslı(Öğrenci), 2012

HAYFAVİ A., Sıçramalı stokastik volatilité ve stokastik faiz oranı modeli ve modelin general electric verisi üzerine uygulaması., Yüksek Lisans, B.Celep(Öğrenci), 2011

HAYFAVİ A., Sürekli zaman beklenen değer varyans optimal portföyleri., Doktora, Ö.Sezgin(Öğrenci), 2011

HAYFAVİ A., YOLCU OKUR Y., Kesirli Brown hareketi ile opsiyon fiyatlaması., Yüksek Lisans, A.İnkaya(Öğrenci), 2011

HAYFAVİ A., EROL I., Levy piyasası modelinde tamlama, fiyatlama ve kalibrasyon., Yüksek Lisans, B.Zeynep(Öğrenci), 2010

HAYFAVİ A., Enflasyona endeksli swapların sıçrama süreci içeren genişletilmiş HJM modeli kullanılarak fiyatlandırılması., Yüksek Lisans, C.Karahan(Öğrenci), 2010

HAYFAVİ A., Additive piyasalarda dinamik kompleks risk minimizasyonu ve portföy optimizasyonu., Yüksek Lisans, O.Polat(Öğrenci), 2009

HAYFAVİ A., Enflasyona endeksli swap ve swap üzerine yazılan opsiyonların hjm modeli kullanılarak fiyatlandırılması, Yüksek Lisans, Z.Canan(Öğrenci), 2009

HAYFAVİ A., Enflasyona endeksli tahvilleri fiyatlamak için sıçramaları içeren bir piyasa modeli, Yüksek Lisans, İ.Ethem(Öğrenci), 2008

HAYFAVİ A., Levy piyasası tamlaması ve portföy optimizasyonu., Yüksek Lisans, A.Türkvatan(Öğrenci), 2008

HAYFAVİ A., Finansal varlıkların fiyatlama modelleri : stokastik volatilitte ve bilgiye dayanan yaklaşımlar, Yüksek Lisans, N.Çalışkan(Öğrenci), 2007

HAYFAVİ A., Kuvvet ve ikili kuvvet varyasyon süreçleri kullanılarak sıçramaların yakalanması, Yüksek Lisans, H.Özlem(Öğrenci), 2007

HAYFAVİ A., Hayat sigortası poliçelerinin stokastik ölüm oranına göre fiyatlanması ve risk süreci modellemesi, Yüksek Lisans, Ş.Çetinkaya(Öğrenci), 2007

HAYFAVİ A., Bariyer opsiyonları için statik hedging stratejileri ve bunların model riskine göre sağlamlığı, Yüksek Lisans, O.Kaya(Öğrenci), 2007

HAYFAVİ A., Stokastik volatilitte, stokastik volatiliteli Vasicek Modeli için yeni bir yaklaşım, Yüksek Lisans, S.Zeytun(Öğrenci), 2005

## SCI, SSCI ve AHCI İndekslerine Giren Dergilerde Yayınlanan Makaleler

- I. **A regime switching model for temperature modeling and applications to weather derivatives pricing**  
Turkvatan A., HAYFAVİ A., Omay T.  
MATHEMATICS AND FINANCIAL ECONOMICS, cilt.14, sa.1, ss.1-42, 2020 (SCI-Expanded)
- II. **Modeling Temperature and Pricing Weather Derivatives Based on Temperature**  
Tastan B., HAYFAVİ A.  
ADVANCES IN METEOROLOGY, 2017 (SCI-Expanded)
- III. **Stochastic multifactor modeling of spot electricity prices**  
HAYFAVİ A., Talasli I.  
JOURNAL OF COMPUTATIONAL AND APPLIED MATHEMATICS, cilt.259, ss.434-442, 2014 (SCI-Expanded)
- IV. **PRICING AND COMPLETION IN A LEVY MARKET MODEL WITH TEUGEL MARTINGALES**  
Okur Y. Y., TEMOÇİN B. Z., HAYFAVİ A.  
HACETTEPE JOURNAL OF MATHEMATICS AND STATISTICS, cilt.41, sa.5, ss.767-783, 2012 (SCI-Expanded)

## Metrikler

Yayın: 4

Atf (WoS): 21

Atf (Scopus): 17

H-İndeks (WoS): 3

H-İndeks (Scopus): 2