

Doç.Dr. ALİ DEVİN SEZER

Kişisel Bilgiler

İş Telefonu: [+90 210 566 5](tel:+902105665)

Fax Telefonu: [+90 210 298 7](tel:+902102987)

E-posta: devin@metu.edu.tr

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

Eğitim Bilgileri

Doktora, Brown University, Division Of Applied Mathematics, Amerika Birleşik Devletleri 2000 - 2006

Yabancı Diller

İngilizce, C1 İleri

Yaptığı Tezler

Doktora, Dynamic Importance Sampling for Queueing Networks, Brown University, Division Of Applied Mathematics, 2006

Araştırma Alanları

Olasılık Kuramı, Stokastik Süreçler

Akademik Unvanlar / Görevler

Doç.Dr., Orta Doğu Teknik Üniversitesi, Uygulamalı Matematik Enstitüsü, Finansal Matematik Anabilim Dalı, 2013 - Devam Ediyor

Yönetilen Tezler

SEZER A. D. , A comparison of constant and stochastic volatility in Merton's portfolio optimization problem, Yüksek Lisans, O.ÖZTÜRK(Öğrenci), 2018

SEZER A. D. , Exit probabilities of constrained simple random walks, Doktora, K.DEMİRBERK(Öğrenci), 2018

SEZER A. D. , Exit probabilities of Markov modulated constrained random walks, Doktora, F.BAŞOĞLU(Öğrenci), 2018

SEZER A. D. , Energy consumption in data centers with deterministic setup times, Yüksek Lisans, A.KARA(Öğrenci), 2017

SEZER A. D. , Application of stochastic volatility models with jumps to bist options, Yüksek Lisans,

M.RAHİMİNEJAT(Öğrenci), 2017

SEZER A. D. , Local volatility model applied to bist30 warrants: Pricing and hedging, Yüksek Lisans, Z.SILA(Öğrenci), 2016

SEZER A. D. , Pricing and hedging of quotient options in Istanbul stock exchange, Yüksek Lisans, A.UMUR(Öğrenci), 2016

SEZER A. D. , Applications of the Heston model on BIST30 warrants : Hedging and pricing, Yüksek Lisans,

Ö.MURAT(Öğrenci), 2016

SEZER A. D. , Pricing and hedging lookback options using black-scholes in borsa İstanbul, Yüksek Lisans,

S.AUGUSTINE(Öğrenci), 2016

SEZER A. D. , District-index insurance program: Basic model and pricing, Yüksek Lisans, İ.AYBERK(Öğrenci), 2015

SEZER A. D. , Pricing and hedging a participating forward contract, Yüksek Lisans, İ.EMRE(Öğrenci), 2013

SEZER A. D. , Temperature in Turkey and Turkish day ahead electricity market prices: Modeling and forecasting, Yüksek Lisans, K.DEMİRBERK(Öğrenci), 2012

SEZER A. D. , Two studies on backward stochastic differential equations, Yüksek Lisans, V.TUNÇ(Öğrenci), 2012

SEZER A. D. , Testing for rational bubbles in the Turkish stock market, Yüksek Lisans, F.BAŞOĞLU(Öğrenci), 2012

SCI, SSCI ve AHCI İndekslerine Giren Dergilerde Yayınlanan Makaleler

- **Excessive backlog probabilities of two parallel queues**
Unlu K. D. , SEZER A. D.
ANNALS OF OPERATIONS RESEARCH, cilt.293, ss.141-174, 2020 (SCI İndekslerine Giren Dergi)
- **Approximation of the exit probability of a stable Markov modulated constrained random walk**
Kabran F. B. , SEZER A. D.
ANNALS OF OPERATIONS RESEARCH, 2020 (SCI İndekslerine Giren Dergi)
- **Backward stochastic differential equations with non-Markovian singular terminal values**
SEZER A. D. , Kruse T, Popier A.
STOCHASTICS AND DYNAMICS, cilt.19, 2019 (SCI İndekslerine Giren Dergi)
- **APPROXIMATION OF EXCESSIVE BACKLOG PROBABILITIES OF TWO TANDEM QUEUES**
SEZER A. D.
JOURNAL OF APPLIED PROBABILITY, cilt.55, ss.968-997, 2018 (SCI İndekslerine Giren Dergi)
- **Stationary analysis of a single queue with remaining service time-dependent arrivals**
Legros B., SEZER A. D.
QUEUEING SYSTEMS, cilt.88, ss.139-165, 2018 (SCI İndekslerine Giren Dergi)
- **Joint densities of hitting times for finite state Markov processes**
Bielecki T. R. , Jeanblanc M., Sezer A. D.
TURKISH JOURNAL OF MATHEMATICS, cilt.42, ss.586-608, 2018 (SCI İndekslerine Giren Dergi)
- **Analysis of push-type epidemic data dissemination in fully connected networks**
ÇAĞLAR M., SEZER A. D.
PERFORMANCE EVALUATION, cilt.77, ss.21-36, 2014 (SCI İndekslerine Giren Dergi)
- **Optimization Methods in Mathematical Finance**
Sezer A. D. , Weber G.
OPTIMIZATION, cilt.62, ss.1399-1402, 2013 (SCI İndekslerine Giren Dergi)
- **Optimal Decision Rules for Product Recalls**
SEZER A. D. , HAKSÖZ Ç.
MATHEMATICS OF OPERATIONS RESEARCH, cilt.37, ss.399-418, 2012 (SCI İndekslerine Giren Dergi)
- **APPROXIMATION OF BOUNDS ON MIXED-LEVEL ORTHOGONAL ARRAYS**
SEZER A. D. , ÖZBUDAK F.
ADVANCES IN APPLIED PROBABILITY, cilt.43, ss.399-421, 2011 (SCI İndekslerine Giren Dergi)
- **Modeling of an insurance system and its large deviations analysis**
Sezer A. D.
JOURNAL OF COMPUTATIONAL AND APPLIED MATHEMATICS, cilt.235, ss.535-546, 2010 (SCI İndekslerine Giren Dergi)
- **Asymptotically optimal importance sampling for Jackson networks with a tree topology**
SEZER A. D.
QUEUEING SYSTEMS, cilt.64, ss.103-117, 2010 (SCI İndekslerine Giren Dergi)
- **Importance sampling for a Markov modulated queuing network**

SEZER A. D.

STOCHASTIC PROCESSES AND THEIR APPLICATIONS, cilt.119, ss.491-517, 2009 (SCI İndekslerine Giren Dergi)

Hakemli Kongre / Sempozyum Bildiri Kitaplarında Yer Alan Yayınlar



Suzaku Analysis of A1800

Aktekin E., GÖK F., Hudaverdi M., SEZER A. D. , ERCAN E. N.

9th International Conference of the Hellenic-Astronomical-Society, Athens, Yunanistan, 20 - 24 Eylül 2009, cilt.424, ss.325-327

Desteklenen Projeler

SEZER A. D. , ÜNLÜ K. D. , BAŞOĞLU F., Yükseköğretim Kurumları Destekli Proje, Markov Süreçleri ve Uygulamaları, 2016 - 2019

Atıflar

Toplam Atıf Sayısı (WOS):21

h-indeksi (WOS):2