

## Prof. Dr. ALİ DEVİN SEZER

### Kişisel Bilgiler

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

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

Web: <https://sites.google.com/site/devinsezer>

### Uluslararası Araştırmacı ID'leri

ScholarID: nI3yB2sAAAAJ

ORCID: 0000-0002-8983-2035

Publons / Web Of Science ResearcherID: AGV-6485-2022

ScopusID: 36935677700

Yoksis Araştırmacı ID: 164960

### 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., Optimal liquidation with conditions on minimum price, Doktora, M.AKSU(Öğrenci), 2022

SEZER A. D., Continuity problem for backward stochastic differential equations with singular nonmarkovian terminal conditions and random terminal times, Doktora, S.AUGUSTINE(Öğrenci), 2021

SEZER A. D., Tekil Markov olmayan son değerleri geriye doğru stokastik diferansiyel denklemlerin deterministik vadelerde çözümlerinin süreklilikleri, Doktora, M.Ahmedi(Öğrenci), 2020

SEZER A. D., İkinci mertebeden market hacimli Almgren-Chriss modelinin özel fonksiyonlar yardımıyla çözümü, Yüksek Lisans, E.Ertürk(Öğrenci), 2020

SEZER A. D., Enflasyona endeksli tahvillerin ve gömülü deflasyon koruma opsiyonlarının fiyatlanması: Türk tahvil piyasası üzerine analiz, Yüksek Lisans, B.Bayram(Öğrenci), 2020

SEZER A. D., Avrupa tipi satın alma opsiyonu fayda kayıtsızlığı fiyatlamasının korunma performansı, Yüksek Lisans, C.Köroğlu(Öğrenci), 2019

SEZER A. D., Merton'un portföy probleminin, sabit volatile ile stokastik volatile olduğu durumlarda karşılaştırılması, Yüksek Lisans, O.Öztürk(Öğrenci), 2018

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., AYAYDIN HACIÖMEROĞLU H., Borsa İstanbul'da oran opsiyonlarının fiyatlaması ve korunumu., Yüksek Lisans, A.Umur(Öğrenci), 2016

SEZER A. D., BIST30 alım satım varantlarına yerel volatilitte modellerinin uygulanması., Yüksek Lisans, Z.Sıla(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., Heston modelinin BIST30 varantları üzerindeki uygulamaları: üretme ve fiyatlama., 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., Local volatility model applied to bist30 warrants: Pricing and hedging, Yüksek Lisans, Z.SILA(Öğrenci), 2016

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

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

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

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

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

- I. **Approximation of the exit probability of a stable Markov modulated constrained random walk**  
Kabran F. B., SEZER A. D.  
ANNALS OF OPERATIONS RESEARCH, cilt.310, sa.2, ss.431-475, 2022 (SCI-Expanded)
- II. **Continuity problem for singular BSDE with random terminal time**  
Samuel S. A., Popier A., SEZER A. D.  
Alea (Rio de Janeiro), cilt.19, sa.2, ss.1185-1220, 2022 (SCI-Expanded)
- III. **Backward stochastic differential equations with non-markovian singular terminal conditions for general driver and filtration**  
Ahmadi M., Popier A., SEZER A. D.  
Electronic Journal of Probability, cilt.26, 2021 (SCI-Expanded)
- IV. **Excessive backlog probabilities of two parallel queues**  
Unlu K. D., SEZER A. D.  
ANNALS OF OPERATIONS RESEARCH, cilt.293, sa.1, ss.141-174, 2020 (SCI-Expanded)
- V. **Backward stochastic differential equations with non-Markovian singular terminal values**

- SEZER A. D., Kruse T., Popier A.  
STOCHASTICS AND DYNAMICS, cilt.19, sa.2, 2019 (SCI-Expanded)
- VI. **APPROXIMATION OF EXCESSIVE BACKLOG PROBABILITIES OF TWO TANDEM QUEUES**  
SEZER A. D.  
JOURNAL OF APPLIED PROBABILITY, cilt.55, sa.3, ss.968-997, 2018 (SCI-Expanded)
- VII. **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-Expanded)
- VIII. **Joint densities of hitting times for finite state Markov processes**  
Bielecki T. R., Jeanblanc M., Sezer A. D.  
TURKISH JOURNAL OF MATHEMATICS, cilt.42, sa.2, ss.586-608, 2018 (SCI-Expanded)
- IX. **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-Expanded)
- X. **Optimal Decision Rules for Product Recalls**  
SEZER A. D., HAKSÖZ Ç.  
MATHEMATICS OF OPERATIONS RESEARCH, cilt.37, sa.3, ss.399-418, 2012 (SCI-Expanded)
- XI. **Modeling of an insurance system and its large deviations analysis**  
Sezer A. D.  
JOURNAL OF COMPUTATIONAL AND APPLIED MATHEMATICS, cilt.235, sa.3, ss.535-546, 2010 (SCI-Expanded)
- XII. **Asymptotically optimal importance sampling for Jackson networks with a tree topology**  
SEZER A. D.  
QUEUEING SYSTEMS, cilt.64, sa.2, ss.103-117, 2010 (SCI-Expanded)
- XIII. **Importance sampling for a Markov modulated queuing network**  
SEZER A. D.  
STOCHASTIC PROCESSES AND THEIR APPLICATIONS, cilt.119, sa.2, ss.491-517, 2009 (SCI-Expanded)

## **Hakemli Kongre / Sempozyum Bildiri Kitaplarında Yer Alan Yayınlar**

- I. **Approximation of Excessive Backlog Probabilities of Two Parallel Queues**  
ÜNLÜ K. D., SEZER A. D.  
The 13th International Conference on Queueing Theory and Network Applications QTNA2018, 25 - 27 Temmuz 2018
- II. **rM/G/1 queue: remaining service time dependent arrivals and iid service times.**  
SEZER A. D., LEGROS B.  
Workshop on Stochastic processes - Actuarial science and Finance, 31 Temmuz - 03 Ağustos 2017
- III. **Backward Stochastic Differential Equations with Nonmarkovian Singular Terminal Values**  
SEZER A. D., KRUSE T., POPIER A.  
Workshop on Stochastic processes - Actuarial science and Finance, 31 Temmuz - 03 Ağustos 2017
- IV. **BIST30 Varantlarına Heston Stokastik Volatilite Modelinin Uygulanması**  
MERT Ö. M., SEZER A. D.  
Yöneylem Araştırması ve Endüstri Mühendisliği 36. Ulusal Kongresi, İzmir, Türkiye, 13 - 15 Temmuz 2016

## **Metrikler**

Yayın: 19

Atf (WoS): 33

Atf (Scopus): 38

H-İndeks (WoS): 3

H-İndeks (Scopus): 4

## **Akademi Dışı Deneyim**

Brown University