

Arş. Gör. ÖZENÇ MURAT MERT

Kişisel Bilgiler

E-posta: mmert@metu.edu.tr

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

Uluslararası Araştırmacı ID'leri

ScholarID: ACMzvzIAAAAJ

ORCID: 0000-0002-3500-1826

Publons / Web Of Science ResearcherID: O-3241-2018

ScopusID: 57221293152

Yoksis Araştırmacı ID: 240213

Eğitim Bilgileri

Doktora, Orta Doğu Teknik Üniversitesi, Uygulamalı Matematik Enstitüsü, Finansal Matematik (Dr), Türkiye 2016 - 2022
Yüksek Lisans, Orta Doğu Teknik Üniversitesi, Uygulamalı Matematik Enstitüsü, Finansal Matematik (YI) (Tezli), Türkiye 2014 - 2016

Lisans, Orta Doğu Teknik Üniversitesi, Fen Edebiyat Fakültesi, Matematik Bölümü, Türkiye 2010 - 2014

Yaptığı Tezler

Doktora, Stochastic modeling of stop-loss reinsurance and exposure curves under time dependent structure, Orta Doğu Teknik Üniversitesi, Uygulamalı Matematik Enstitüsü, 2022

Yüksek Lisans, Applications of the Heston model on BIST30 warrants : Hedging and pricing, Orta Doğu Teknik Üniversitesi, Uygulamalı Matematik Enstitüsü, Finansal Matematik (YI) (Tezli), 2016

Araştırma Alanları

Temel Bilimler

Akademik Unvanlar / Görevler

Araştırma Görevlisi, Orta Doğu Teknik Üniversitesi, Uygulamalı Matematik Enstitüsü, Finansal Matematik Anabilim Dalı, 2015 - Devam Ediyor

SCI, SSCI ve AHCI İndekslerine Giren Dergilerde Yayınlanan Makaleler

I. Optimal premium allocation under stop-loss insurance using exposure curves

Mert Ö. M., Kestel A. S.

HACETTEPE JOURNAL OF MATHEMATICS AND STATISTICS, cilt.51, sa.1, ss.288-307, 2022 (SCI-Expanded)

II. Time dependent stop-loss reinsurance and exposure curves

Mert Ö. M., Kestel A. S.

JOURNAL OF COMPUTATIONAL AND APPLIED MATHEMATICS, cilt.389, 2021 (SCI-Expanded)

Kitaplar

- I. **Modelling Natural Gas Future Prices via Hybrid Stochastic Diffusion Processes**
MERT Ö. M., KOÇ O., KESTEL A. S.
Energy Entrepreneurship, Sustainability, Innovation and Financing, , Editör, Springer, ss.297-324, 2025
- II. **Forecasting the Hydro Inflow and Optimization of Virtual Power Plant Pricing**
ÇABUK S., MERT Ö. M., KESTEL A. S., Kalaycı E.
Applied Operations Research and Financial Modelling in Energy, André B. DorsmanKazim Baris AticiAydin
UlucanMehmet Baha Karan, Editör, Springer, ss.125-152, 2021

Hakemli Kongre / Sempozyum Bildiri Kitaplarında Yer Alan Yayınlar

- I. **Stop-loss reinsurance pricing and exposure curves under jump influence**
MERT Ö. M., KESTEL A. S.
Family Workshop (Financial and Actuarial Mathematics in Liverpool, Leeds, York), Liverpool, İngiltere, 07 Aralık 2023, ss.1
- II. **TIME DEPENDENT STOP-LOSS REINSURANCE AND EXPOSURE CURVES VIA STOCHASTIC JUMP DIFFUSION**
MERT Ö. M., KESTEL A. S.
26th International Congress on Insurance: Mathematics and Economics, Edinburgh, Saint Helena, 4 - 07 Temmuz 2023, ss.86
- III. **Time Dependent Stop-Loss Reinsurance and Exposure Curves**
Mert Ö. M., Kestel A. S.
Virtual 24th International Congress on Insurance: Mathematics and Economics, Illinois, Amerika Birleşik Devletleri, 5 - 09 Temmuz 2021, ss.145-146
- IV. **Time Dependent Stop-Loss Reinsurance and Exposure Curves**
MERT Ö. M., KESTEL A. S.
Virtual 24th International Congress on Insurance: Mathematics and Economics, Amerika Birleşik Devletleri, 05 Temmuz 2021
- V. **Optimal Stop-Loss Reinsurance: A Dependence Analysis of Aggregate Claims under Certain Distributions**
MERT Ö. M., KESTEL A. S.
4th European Actuarial Journal Conference, Leuven, Belçika, 9 - 11 Eylül 2018, ss.61
- VI. **Dependence Analysis with Normally Distributed Aggregate Claims in Stop Loss Insurance**
MERT Ö. M., KESTEL A. S.
10th Internatioanal Statistics Congress (ISC2017) Ankara, Ankara, Türkiye, 6 - 08 Aralık 2017
- VII. **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

Desteklenen Projeler

KESTEL A. S., YILDIRIM B., AKARSU G., MERT Ö. M., HASGÜL E., ŞİMŞEK M., Yükseköğretim Kurumları Destekli Proje, Hayat ve Hayat Dışı Sigorta Şirketlerinde Mali Yeterlilik Kriterlerine ait Faktörlerin Modellenmesi, 2017 - 2019

Metrikler

Yayın: 13

Atıf (WoS): 2

Atıf (Scopus): 2

H-İndeks (WoS): 1

H-İndeks (Scopus): 1

Kongre ve Sempozyum Katılımı Faaliyetleri

Yöneylem Araştırması ve Endüstri Mühendisliği 36 Ulusal Kongresi, Panelist, İzmir, Türkiye, 2016