

## Arş.Gör. ÖZENÇ MURAT MERT

### Kişisel Bilgiler

E-posta: mmert@metu.edu.tr

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

### Eğitim Bilgileri

Doktora, Orta Doğu Teknik Üniversitesi, Uygulamalı Matematik Enstitüsü, Finansal Matematik (Dr), Türkiye 2016 - Devam Ediyor

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

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.1, sa.1, ss.1-20, 2021 (SCI Expanded İndekslerine Giren Dergi)
- 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 İndekslerine Giren Dergi)

### Kitap & Kitap Bölümleri

- I. **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

## Hakemli Kongre / Sempozyum Bildiri Kitaplarında Yer Alan Yayınlar

- I. **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
- II. **Time Dependent Stop-Loss Reinsurance and Exposure Curves**  
Mert Ö. M. , Kestel A. S.  
Virtual 25th International Congress on Insurance: Mathematics and Economics, Illinois, Amerika Birleşik Devletleri, 5 - 09 Temmuz 2021, ss.145-146
- III. **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
- IV. **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
- V. **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

## Kongre ve Sempozyum Katılımı Faaliyetleri

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

## Atıflar

Toplam Atıf Sayısı (WOS):1

h-indeksi (WOS):1