

## 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

- 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)
- 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)

### III. 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)

## 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

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 International 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