

Prof. ÖMER ÖNALAN

Personal Information

Email: omeronalan@marmara.edu.tr

Education Information

Doctorate, Marmara University, Institute of Social Sciences, Sayısal Yöntemler (Dr), Turkey 1992 - 1996

Post Graduate, Marmara University, Faculty of Business Administration, Business Administration, Turkey 1990 - 1992

Under Graduate, Çukurova Üniversitesi, Fen-Edebiyat Fakültesi, Matematik Bölümü, Turkey 1984 - 1988

Dissertations

Post Graduate, Stokastik süreç olarak markov zincirleri ve kuyruk teorisinin incelenmesi, Marmara Üniversitesi, İşletme Fakültesi, İşletme Bölümü, 1992

Doctorate, Hisse senedi fiyat değişimlerinin stokastik süreç olarak analizi, Marmara Üniversitesi, Sosyal Bilimler Enstitüsü, Sayısal Yöntemler (Dr), 1990

Research Areas

Quantitative Methods

Academic Titles / Tasks

Professor, Marmara University, Faculty of Business Administration, Business Administration, 2012 - Continues

Associate Professor, Marmara University, Faculty of Business Administration, Business Administration, 2005 - 2012

Assistant Professor, Marmara University, Faculty of Business Administration, Business Administration, 2000 - 2005

Research Assistant, Marmara University, Faculty of Business Administration, Business Administration, 1989 - 2000

Professional Experience

Head of Department, Marmara University, Faculty of Business Administration, Business Administration, 2012 - 2013

Advising Theses

ÖNALAN Ö., Uç değerler teorisini kullanarak koşullu risk ölçümlerinin tahmini ve döviz kurlarına bir uygulama, Post Graduate, Y.Kızılay(Student), 2019

ÖNALAN Ö., İşlem hacmi değişimlerinin fiyatlar üzerindeki etkisi ve Bist'de uygulaması, Post Graduate, T.Buğra(Student), 2016

ÖNALAN Ö., Vergi yükünün gayrimenkul yatırımlarına etkisi ve Türkiye uygulaması, Post Graduate, M.Kalender(Student), 2013

ÖNALAN Ö., Gayrimenkul yatırımlarında getiri-risk hesabı ve Türkiye'de bir uygulama, Post Graduate, H.Hüseyin(Student), 2012

ÖNALAN Ö., Çok kriterli karar vermede kullanılan topsis ve ahp yöntemlerinin karşılaştırılması ve bir uygulama, Post Graduate, H.Subaşı(Student), 2011

ÖNALAN Ö., Coğrafi bilgi sistemi yatırımlarının analizi ve bir uygulama, Post Graduate, U.Aziz(Student), 2011

ÖNALAN Ö., Yatırım fonu stratejileri arasındaki bağımlılığın copula ile modellenmesi ve bir uygulama, Post Graduate, Ö.Avutman(Student), 2011

ÖNALAN Ö., Ekstrem değer teorisi ve inşaat sektöründe bir uygulama, Post Graduate, H.Palas(Student), 2009

ÖNALAN Ö., Faiz oranlarının hisse senedi getirileri üzerindeki etkisi ve İMKB'de bir uygulama, Post Graduate, S.Tezcan(Student), 2009

ÖNALAN Ö., Sermaye varlıkları fiyatlama modeli çerçevesinde risk getiri ilişkisi ve İMKB'ye bir uygulama, Post Graduate, A.Çomak(Student), 2009

ÖNALAN Ö., Dağıtım kanallarında oyun teorisi yaklaşımının kullanımı ve bir uygulama, Post Graduate, Ü.Biçici(Student), 2009

ÖNALAN Ö., Telekomünikasyon sektöründeki esnek yatırım kararlarında reel opsiyonların uygulanması, Post Graduate, O.Çalıkıuş(Student), 2008

ÖNALAN Ö., Operasyonel kayıpların ölçümü ve imalat sektörüne bir uygulama, Post Graduate, E.Zülfikaroğlu(Student), 2008

ÖNALAN Ö., Lojistik yönetimde operasyonel kayıpların ölçümü ve bir uygulama, Post Graduate, U.Ayaz(Student), 2007

ÖNALAN Ö., Çağrı merkezlerinde verimliliğin optimizasyonu, Post Graduate, Ö.Kıraçlı(Student), 2007

ÖNALAN Ö., Operasyonel risk hesabında sayısal yöntemler ve Türkiye'de bir uygulama, Post Graduate, E.Kasımoğlu(Student), 2007

ÖNALAN Ö., Yatırım projelerinin analizinde reel opsiyonların kullanılması ve bir uygulama, Post Graduate, İ.Bostan(Student), 2007

Önalın Ö., Operasyonel riskin ekstrem değer teorisi kullanılarak ölçümü ve bir uygulama, Post Graduate, Ö.GÜRİSOY(Student), 2006

ÖNALAN Ö., Stokastik sipariş miktar modelleri ve telekomünikasyon sektöründe bir uygulaması, Post Graduate, S.Şahin(Student), 2004

Önalın Ö., Stokastik ekonomik sipariş miktar modelleri ve telekomünikasyon sektöründe bir uygulaması, Post Graduate, S.ŞAHİN(Student), 2004

Önalın Ö., Hava yolcu taşımacılığında talep tahmin modellemesi ve Türkiye için bir uygulama, Post Graduate, S.ERTEKİN(Student), 2004

Önalın Ö., Finansal varlık fiyatlama modeli ve arbitraj fiyatlama modelinin İMKB'de test edilmesi, Post Graduate, D.AYSOY(Student), 2004

Önalın Ö., Portföy seçim modelleri ve İMKB `ye bir uygulama, Post Graduate, Z.ALAKURT(Student), 2002

Articles Published in Other Journals

- I. **Estimation of economic growth using Grey Cobb-Douglas production function: an application for US economy**
ÖNALAN Ö., BAŞEĞMEZ H.
Journal of Business, Economics and Finance (JBEF), vol.7, pp.178-190, 2018 (Refereed Journals of Other Institutions)
- II. **Time-changed generalized mixed fractional Brownian motion and application to arithmetic average Asian option pricing**
ÖNALAN Ö.
International Journal of Applied Mathematical Research, vol.6, pp.85, 2017 (Refereed Journals of Other Institutions)
- III. **The modeling of extreme stochastic dependence using copulas and extreme value theory: case study from energy prices**
ÖNALAN Ö.
Global Journal of Mathematical Analysis, vol.5, pp.29-36, 2017 (Refereed Journals of Other Institutions)

- IV. **Meixner Süreci İle Reel Efektif Döviz Kuru nun Modellenmesi**
ÖNALAN Ö.
İktisadi ve İdari Bilimler Dergisi, vol.30, pp.263-281, 2011 (Refereed Journals of Other Institutions)
- V. **Pure jump levy processes and self decomposability in financial modeling**
ÖNALAN Ö.
Journal of Mathematics Research, vol.3, pp.41, 2011 (Refereed Journals of Other Institutions)
- VI. **KARARLI DAĞILIMLARLA FİNANSAL RİSK ÖLÇÜMÜ**
ÖNALAN Ö.
İktisadi ve İdari Bilimler Dergisi, vol.28, pp.549-571, 2010 (Refereed Journals of Other Institutions)
- VII. **Financial risk management with normal inverse Gaussian distributions**
ÖNALAN Ö.
International Research Journal of Finance and Economics, vol.38, pp.104-115, 2010 (Refereed Journals of Other Institutions)
- VIII. **VASICEK VE CIR MODELLERİ KULLANILARAK OYNAKLIK VE FAİZ ORANLARININ MODELLENMESİ**
ÖNALAN Ö.
İktisadi ve İdari Bilimler Dergisi, vol.27, 2009 (Refereed Journals of Other Institutions)
- IX. **Martingale measures for NIG Lévy processes with applications to mathematical finance**
ÖNALAN Ö.
International Research Journal of Finance and Economics, vol.34, pp.56-68, 2009 (Refereed Journals of Other Institutions)
- X. **Financial modelling with Ornstein Uhlenbeck processes driven by Lévy process**
ÖNALAN Ö.
Proceedings of the World Congress on Engineering, vol.2, pp.1-3, 2009 (Refereed Journals of Other Institutions)
- XI. **Finansal zaman serileri için ortalamaya dönme sıçrama difüzyonu modeli**
ÖNALAN Ö.
İktisadi ve İdari Bilimler Dergisi, vol.22, pp.201-224, 2007 (Refereed Journals of Other Institutions)
- XII. **MENKUL KIYMET FİYATLARININ STOKASTİK SÜREÇ OLARAK MODELLENMESİ**
ÖNALAN Ö.
Dokuz Eylül Üniversitesi İşletme Fakültesi Dergisi, vol.4, 2003 (Refereed Journals of Other Institutions)
- XIII. **Finansal risk yönetiminde ekstrem değer teorisi**
ÖNALAN Ö.
İktisadi ve İdari Bilimler Dergisi, vol.18, pp.423-437, 2003 (Refereed Journals of Other Institutions)
- XIV. **Markov Süreçleri**
ÖNALAN Ö.
Marmara Üniversitesi Öneri Dergisi, vol.1, 1994 (Other Refereed National Journals)

Books & Book Chapters

- I. **Stokastik Süreçler**
ÖNALAN Ö.
Avcıol Basım-Yayın, İstanbul, 2010
- II. **İşletme Matematiği**
ÖNALAN Ö.
Avcıol Basım-Yayın, İstanbul, 2010
- III. **Finans Mühendisliğinde Matematiksel Modelleme**
ÖNALAN Ö.
Avcıol Basım-Yayın, İstanbul, 2004

Refereed Congress / Symposium Publications in Proceedings

- I. **Prediction of gross domestic product (GDP) by using Grey Cobb-Douglas production function**
ÖNALAN Ö., BAŞEĞMEZ H.
4th Global Business Research Congress, İstanbul, Turkey, 24 - 25 May 2018, vol.7, pp.18-23
- II. **Subdiffusive Ornstein-Uhlenbeck Processes and Applications to Finance**
ÖNALAN Ö.
World Congress on Engineering (WCE 2015), London, Canada, 1 - 03 July 2015, pp.697-703
- III. **Financial Modelling with Ornstein-Uhlenbeck Processes Driven by Levy Process**
Onalan O.
World Congress on Engineering, London, Canada, 1 - 03 July 2009, pp.1350-1355
- IV. **Financial asset returns modeling using stable self similar processes**
ÖNALAN Ö.
Stochastic Finance, 01 July 2004