

Prof.Dr. ÖMER ÖNALAN

Kişisel Bilgiler

E-posta: omeronalan@marmara.edu.tr

Eğitim Bilgileri

Doktora, Marmara Üniversitesi, Sosyal Bilimler Enstitüsü, Sayısal Yöntemler (Dr), Türkiye 1992 - 1996

Yüksek Lisans, Marmara Üniversitesi, İşletme Fakültesi, İşletme Bölümü, Türkiye 1990 - 1992

Lisans, Çukurova Üniversitesi, Fen-Edebiyat Fakültesi, Matematik Bölümü, Türkiye 1984 - 1988

Yaptığı Tezler

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

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

Araştırma Alanları

Sayısal Yöntemler

Akademik Unvanlar / Görevler

Prof.Dr., Marmara Üniversitesi, İşletme Fakültesi, İşletme Bölümü, 2012 - Devam Ediyor

Doç.Dr., Marmara Üniversitesi, İşletme Fakültesi, İşletme Bölümü, 2005 - 2012

Yrd.Doç.Dr., Marmara Üniversitesi, İşletme Fakültesi, İşletme Bölümü, 2000 - 2005

Araştırma Görevlisi, Marmara Üniversitesi, İşletme Fakültesi, İşletme Bölümü, 1989 - 2000

Mesleki Deneyim

Bölüm Başkanı, Marmara Üniversitesi, İşletme Fakültesi, İşletme Bölümü, 2012 - 2013

Yönetilen Tezler

ÖNALAN Ö., Uç değerler teorisini kullanarak koşullu risk ölçümlerinin tahmini ve döviz kurlarına bir uygulama, Yüksek Lisans, Y.Kızılay(Öğrenci), 2019

ÖNALAN Ö., İşlem hacmi değişimlerinin fiyatlar üzerindeki etkisi ve Bist'de uygulaması, Yüksek Lisans, T.Buğra(Öğrenci), 2016

ÖNALAN Ö., Vergi yükünün gayrimenkul yatırımlarına etkisi ve Türkiye uygulaması, Yüksek Lisans, M.Kalender(Öğrenci), 2013

ÖNALAN Ö., Gayrimenkul yatırımlarında getiri-risk hesabı ve Türkiye'de bir uygulama, Yüksek Lisans, H.Hüseyin(Öğrenci), 2012

ÖNALAN Ö., Çok kriterli karar vermede kullanılan topsis ve ahp yöntemlerinin karşılaştırılması ve bir uygulama, Yüksek Lisans, H.Subaşı(Öğrenci), 2011

ÖNALAN Ö., Coğrafi bilgi sistemi yatırımlarının analizi ve bir uygulama, Yüksek Lisans, U.Aziz(Öğrenci), 2011

ÖNALAN Ö., Yatırım fonu stratejileri arasındaki bağımlılığın copula ile modellenmesi ve bir uygulama, Yüksek Lisans, Ö.Avutman(Öğrenci), 2011

ÖNALAN Ö., Ekstrem değer teorisi ve inşaat sektöründe bir uygulama, Yüksek Lisans, H.Palas(Öğrenci), 2009

ÖNALAN Ö., Faiz oranlarının hisse senedi getirileri üzerindeki etkisi ve İMKB'de bir uygulama, Yüksek Lisans, S.Tezcan(Öğrenci), 2009

ÖNALAN Ö., Sermaye varlıkları fiyatlama modeli çerçevesinde risk getiri ilişkisi ve İMKB'ye bir uygulama, Yüksek Lisans, A.Çomak(Öğrenci), 2009

ÖNALAN Ö., Dağıtım kanallarında oyun teorisi yaklaşımının kullanımı ve bir uygulama, Yüksek Lisans, Ü.Biçici(Öğrenci), 2009

ÖNALAN Ö., Telekomünikasyon sektöründeki esnek yatırım kararlarında reel opsiyonların uygulanması, Yüksek Lisans, O.Çalıkış(Öğrenci), 2008

ÖNALAN Ö., Operasyonel kayıpların ölçümü ve imalat sektörüne bir uygulama, Yüksek Lisans, E.Zülfikaroğlu(Öğrenci), 2008

ÖNALAN Ö., Lojistik yönetimde operasyonel kayıpların ölçümü ve bir uygulama, Yüksek Lisans, U.Ayaz(Öğrenci), 2007

ÖNALAN Ö., Çağrı merkezlerinde verimliliğin optimizasyonu, Yüksek Lisans, Ö.Kıraçlı(Öğrenci), 2007

ÖNALAN Ö., Operasyonel risk hesabında sayısal yöntemler ve Türkiye'de bir uygulama, Yüksek Lisans, E.Kasımoğlu(Öğrenci), 2007

ÖNALAN Ö., Yatırım projelerinin analizinde reel opsiyonların kullanılması ve bir uygulama, Yüksek Lisans, İ.Bostan(Öğrenci), 2007

Önalın Ö., Operasyonel riskin ekstrem değer teorisi kullanılarak ölçümü ve bir uygulama, Yüksek Lisans, Ö.GÜRİSOY(Öğrenci), 2006

ÖNALAN Ö., Stokastik sipariş miktar modelleri ve telekomünikasyon sektöründe bir uygulaması, Yüksek Lisans, S.Şahin(Öğrenci), 2004

Önalın Ö., Stokastik ekonomik sipariş miktar modelleri ve telekomünikasyon sektöründe bir uygulaması, Yüksek Lisans, S.ŞAHİN(Öğrenci), 2004

Önalın Ö., Hava yolcu taşımacılığında talep tahmin modellemesi ve Türkiye için bir uygulama, Yüksek Lisans, S.ERTEKİN(Öğrenci), 2004

Önalın Ö., Finansal varlık fiyatlama modeli ve arbitraj fiyatlama modelinin İMKB'de test edilmesi, Yüksek Lisans, D.AYSOY(Öğrenci), 2004

Önalın Ö., Portföy seçim modelleri ve İMKB `ye bir uygulama, Yüksek Lisans, Z.ALAKURT(Öğrenci), 2002

Diğer Dergilerde Yayınlanan Makaleler

- 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), cilt.7, ss.178-190, 2018 (Diğer Kurumların Hakemli Dergileri)
- II. **Time-changed generalized mixed fractional Brownian motion and application to arithmetic average Asian option pricing**
ÖNALAN Ö.
International Journal of Applied Mathematical Research, cilt.6, ss.85, 2017 (Diğer Kurumların Hakemli Dergileri)
- 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, cilt.5, ss.29-36, 2017 (Diğer Kurumların Hakemli Dergileri)
- IV. **Meixner Süreci İle Reel Efektif Döviz Kuru nun Modellenmesi**
ÖNALAN Ö.

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

Kitap & Kitap Bölümleri

- 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

Hakemli Kongre / Sempozyum Bildiri Kitaplarında Yer Alan Yayınlar

- I. **Prediction of gross domestic product (GDP) by using Grey Cobb-Douglas production function**

ÖNALAN Ö., BAŞEĞMEZ H.

4th Global Business Research Congress, İstanbul, Türkiye, 24 - 25 Mayıs 2018, cilt.7, ss.18-23

II. Subdiffusive Ornstein-Uhlenbeck Processes and Applications to Finance

ÖNALAN Ö.

World Congress on Engineering (WCE 2015), London, Kanada, 1 - 03 Temmuz 2015, ss.697-703

III. Financial Modelling with Ornstein-Uhlenbeck Processes Driven by Levy Process

Onalan O.

World Congress on Engineering, London, Kanada, 1 - 03 Temmuz 2009, ss.1350-1355

IV. Financial asset returns modeling using stable self similar processes

ÖNALAN Ö.

Stochastic Finance, 01 Temmuz 2004