

Prof. Dr. ÖMER ÖNALAN

Kişisel Bilgiler

E-posta: omeronalan@marmara.edu.tr

Web: <https://avesis.marmara.edu.tr/omeronalan>

Uluslararası Araştırmacı ID'leri

ScholarID: D73CU6kAAAAJ

ORCID: 0000-0003-3996-3616

Yoksis Araştırmacı ID: 12016

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

Akademik İdari Deneyim

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

SCI, SSCI ve AHCI İndekslerine Giren Dergilerde Yayınlanan Makaleler

- I. **JOINT MODELLING OF S&P500 AND VIX INDICES WITH ROUGH FRACTIONAL ORNSTEIN-UHLENBECK VOLATILITY MODEL**
ÖNALAN Ö.
Romanian Journal of Economic Forecasting, cilt.25, sa.1, ss.68-84, 2022 (SSCI)
- II. **JOINT MODELLING OF S&P500 AND VIX INDICES WITH ROUGH FRACTIONAL ORNSTEIN-UHLENBECK VOLATILITY MODEL**
ÖNALAN Ö.
ROMANIAN JOURNAL OF ECONOMIC FORECASTING, cilt.25, sa.1, ss.68-84, 2022 (SSCI)

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 (Hakemli Dergi)
- 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 (Hakemli Dergi)
- 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 (Hakemli Dergi)
- IV. **Meixner Süreci İle Reel Efektif Döviz Kuru nun Modellenmesi**
ÖNALAN Ö.
İktisadi ve İdari Bilimler Dergisi, cilt.30, ss.263-281, 2011 (Hakemli Dergi)
- V. **Pure jump levy processes and self decomposability in financial modeling**
ÖNALAN Ö.
Journal of Mathematics Research, cilt.3, ss.41, 2011 (Hakemli Dergi)
- VI. **KARARLI DAĞILIMLARLA FİNANSAL RİSK ÖLÇÜMÜ**
ÖNALAN Ö.
İktisadi ve İdari Bilimler Dergisi, cilt.28, ss.549-571, 2010 (Hakemli Dergi)
- VII. **Financial risk management with normal inverse Gaussian distributions**
ÖNALAN Ö.
International Research Journal of Finance and Economics, cilt.38, ss.104-115, 2010 (Scopus)
- VIII. **VASICEK VE CIR MODELLERİ KULLANILARAK OYNAKLIK VE FAİZ ORANLARININ MODELLENMESİ**
ÖNALAN Ö.
İktisadi ve İdari Bilimler Dergisi, cilt.27, 2009 (Hakemli Dergi)
- 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 (Scopus)
- 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 (Hakemli Dergi)
- XI. **Finansal zaman serileri için ortalamaya dönme sıçrama difüzyonu modeli**
ÖNALAN Ö.
İktisadi ve İdari Bilimler Dergisi, cilt.22, ss.201-224, 2007 (Hakemli Dergi)
- XII. **MENKUL KIYMET FİYATLARININ STOKASTİK SÜREÇ OLARAK MODELLENMESİ**
ÖNALAN Ö.
Dokuz Eylül Üniversitesi İşletme Fakültesi Dergisi, cilt.4, 2003 (Hakemli Dergi)
- XIII. **Finansal risk yönetiminde ekstrem değer teorisi**
ÖNALAN Ö.
İktisadi ve İdari Bilimler Dergisi, cilt.18, ss.423-437, 2003 (Hakemli Dergi)
- XIV. **Markov Süreçleri**
ÖNALAN Ö.
Marmara Üniversitesi Öneri Dergisi, cilt.1, 1994 (Hakemli Dergi)

Kitap & Kitap Bölümleri

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

Metrikler

Yayın: 23

Atıf (Scopus): 4

H-İndeks (Scopus): 1