



OĞUZ ERSAN

Öğrenim Bilgileri

01 Şubat 2009 - 01 Haziran 2016 (7 yıl 5 ay)

Doktora, Doktora, YEDİTEPE ÜNİVERSİTESİ, TÜRKİYE
SOSYAL BİLİMLER ENSTİTÜSÜ, FİNANSAL İKTİSAT (DR)

Tez Başlığı: Towards Better Protection From Superiority By Increased Precision In Detection: The Case Of Financial Markets With Informed And High-frequency Trading

Tez Konusu: Bu Çalışma Finansal Piyasalarda Gerçekleşen Özel Bilgi Kaynaklı İşlemler Ve Yüksek Frekanslı İşlemlere (hft) Dair Ölçme Yöntemlerinin İyileştirilmesi Ve Geliştirilmesi Yönünde İlerlemektedir. İlk Bölüm Sıkça Kullanılan Pın (özel Bilgi Kaynaklı İşlem Olasılığı) (easley Vd., 1996) Ölçeği İçin Hatasız Bir Hesaplama Yöntemi Önerir. Ayrıca, Hesaplama Süresi On Yedide Bire İndirilir. Sonraki Bölümde, Çok Katmanlı Özel Bilgi Kaynaklı İşlem Olasılığı (mpin) İsimli Yeni Bir Ölçek Sunulur. Genişleyen Hesaplama Problemleri İçin Gerekli Çözümler Sunulur. Üçüncü Bölüm 85 Milyon Emirde 243 Milyon Mesajın İncelenmesi İle Bist'teki Hft Seviyesini Ölçmektedir.

Tarih: 2016

01 Eylül 2006 - 01 Haziran 2008 (1 yıl 10 ay)

Yüksek Lisans, Tezli Program, STOCKHOLM SCHOOL OF ECONOMICS, İSVEÇ
STOCKHOLM SCHOOL OF ECONOMICS, STOCKHOLM SCHOOL OF ECONOMICS

Tez Başlığı: Book-to-market Effect And Fama French Model In Bear-bull Markets

Tez Konusu: Defter Değeri / Piyasa Değeri Oranı Etkisinin Düşen Piyasa Koşullarında Yüksek Miktarda Mevcut Olduğu, Olumlu Piyasa Koşullarında İse Sıfırdan Farksız Olduğu Ortaya Konmuştur. Bu Temel Bulgu Fama French 3 Faktör Modelini Risk Ve Beklenen Getiri Seviyelerinin Tahmini Noktasında Olumsuz Etkilemektedir.

Tarih: 2008

01 Eylül 2000 - 01 Eylül 2005 (5 yıl 1 ay)

Lisans, Anadal/Normal Öğretim, SABANCI ÜNİVERSİTESİ, TÜRKİYE
SANAT VE SOSYAL BİLİMLER FAKÜLTESİ, EKONOMİ PR. (ÜCRETLİ)

Deneyim / İşyeri Bilgileri

01 Şubat 2023 - Şu Anda (2 ay) (Tam Zamanlı)

DOÇ. DR., KADİR HAS ÜNİVERSİTESİ İKTİSADİ, İDARİ VE SOSYAL BİLİMLER FAKÜLTESİ ULUSLARARASI TİCARET VE FİNANSMAN BÖLÜMÜ ULUSLARARASI TİCARET VE FİNANSMAN PR. (İNGİLİZCE) (TAM BURSULU)

01 Ocak 2018 - 01 Ocak 2023 (5 yıl 1 ay) (Tam Zamanlı)
DOKTORALI ÖĞRETİM ÜYESİ, DR. ÖĞR. ÜYESİ, KADİR HAS ÜNİVERSİTESİ

01 Ocak 2017 - 01 Ocak 2018 (1 yıl 1 ay) (Tam Zamanlı)
ARAŞTIRMA GÖREVLİSİ (DR.), İSTANBUL TEKNİK ÜNİVERSİTESİ İŞLETME
FAKÜLTESİ İŞLETME MÜHENDİSLİĞİ BÖLÜMÜ

Yabancı Dil Bilgileri

İSPANYOLCA (Okuma: Başlangıç, Yazma: Başlangıç, Konuşma: Başlangıç)

İNGİLİZCE (Okuma: İyi, Yazma: İyi, Konuşma: İyi)

Bilimsel Teknolojik Faaliyet Alanları

Bilimsel Teknolojik Faaliyet Alanı Bilgileri

Sosyal ve Beşeri Bilimler -- Finans Ekonomisi

Sosyal ve Beşeri Bilimler -- İşletme -- Finansal Piyasalar ve Yatırım Yönetimi

Teknik Bilimler -- Endüstri Mühendisliği -- Mühendislik Ekonomisi -- Finansal
Modeller ve Uygulamaları

Anahtar Kelimeler

Finansal Piyasalar

Piyasa Mikroyapısı

İstatistiksel Programlama

Algoritmik İşlemler

Büyük Veri Analizi

Yüksek Frekanslı Veri

Yüksek Frekanslı Veri Analizi

Davranışsal Finans

Davranışsal Ekonomi

Bilgi Asimetrisi

Piyasa Anomalileri

Piyasa Aksaklıkları

Finansal Ekonomi

Finansal Hesaplama

Finansal Matematik

Finansal Mühendislik

Ar-Ge Yetkinlik

Kitaplar

O. ERSAN, G. GÖZGÖR & E. DEMİR, Once Upon a Time: The Ramadan Effect in Turkey, H. SUMER, H. PERNSTEINER & M. ULUSAN POLAT [Editörler], Behavioral Finance, AVUSTURYA: Linde, 12 Haziran 2019, Kitapta Bölüm.

Makaleler

E. DEMİR, O. ERSAN & B. POPESKO, Are Fan Tokens Fan Tokens?, FINANCE RESEARCH LETTERS, 2022, 1544-6123, 47.

O. ERSAN, E. DEMİR & A. ASSAF, Connectedness among fan tokens and stocks of football clubs, RESEARCH IN INTERNATIONAL BUSINESS AND FINANCE, 2022, 0275-5319, 63.

C. EKİNCİ & O. ERSAN, High-frequency trading and market quality: The case of a "slightly exposed" market, INTERNATIONAL REVIEW OF FINANCIAL ANALYSIS, 2022, 1057-5219, 79.

N. DALGIÇ, C. EKİNCİ & O. ERSAN, Daily and Intraday Herding within Different Types of Investors in Borsa Istanbul, EMERGING MARKETS FINANCE AND TRADE, 2021, 1540-496X, 57, 6, 1793-1810.

O. ERSAN, N. DALGIÇ, C. E. EKİNCİ & M. BODUR, High-Frequency Trading and its Impact on Market Liquidity: A Review of Literature, Alanya Akademik Bakış, 2021, 2651-4192, 5, 1, 345-368.

O. ERSAN, S. A. SİMSİR, K. D. SİMSEK & A. HASAN, The speed of stock price adjustment to corporate announcements: Insights from Turkey, EMERGING MARKETS REVIEW, 2021, 1566-0141, 47.

G. O. DANİSMAN, O. ERSAN & E. DEMİR, Economic policy uncertainty and bank credit growth: Evidence from European banks, JOURNAL OF MULTINATIONAL FINANCIAL MANAGEMENT, 2020, 1042-444X, 57-58.

O. ERSAN & M. ÇANAKÇIOĞLU, Şirket Kârlılığının Finansal Belirleyicileri: Gıda Sektörü Üzerine Bir Araştırma, Mali Çözüm, 2020, 1303-5444, 30, 159, 69-89.

O. ERSAN, S. AKRON & E. DEMİR, The effect of European and global uncertainty on stock returns of travel and leisure companies, TOURISM ECONOMICS, 2019, 1354-8166, 25, 1, 51-66.

C. EKİNCİ & O. ERSAN, A new approach for detecting high-frequency trading from order and trade data, FINANCE RESEARCH LETTERS, 2018, 1544-6123, 24, 313-320.

E. DEMİR & O. ERSAN, The impact of economic policy uncertainty on stock returns of Turkish tourism companies, CURRENT ISSUES IN TOURISM, 2018, 1368-3500, 21, 8, 847-855.

E. DEMİR & O. ERSAN, Economic policy uncertainty and cash holdings: Evidence from BRIC countries, EMERGING MARKETS REVIEW, 2017, 1566-0141, 33, 189-200.

O. ERSAN & E. DEMİR, New Season New Hopes: Off-Season Optimism, Eurasian Journal of Economics and Finance,, 2017, 2148-0192, 5, 4, 36-49.

O. ERSAN & C. E. EKİNCİ, Algorithmic And High-frequency Trading In Borsa Istanbul, borsa istanbul review, 2016, 2214-8450, 16, 4, 233-248.

O. ERSAN & A. ALİCİ, An unbiased computation methodology for estimating the probability of informed trading (PIN), JOURNAL OF INTERNATIONAL FINANCIAL MARKETS INSTITUTIONS & MONEY, 2016, 1042-4431, 43, 74-94.

E. DEMİR & O. ERSAN, When Stock Market Investors Breathe Polluted Air, Tam Metin Bildiri, 15th Eurasia Business And Economics Society Conference, 08 Ocak 2015, 10 Ocak 2015, 2, 705 - 720.

M. BODUR (Tez Yazarı) , O. ERSAN (Tez Danışmanı) , Informed trading around extreme events in Borsa Istanbul, 2022.

İ. DAŞTAN (Tez Yazarı) , O. ERSAN (Tez Danışmanı) , Yüksek frekanslı işlemlerin Borsa İstanbul pay piyasasındaki uç fiyat hareketleri çerçevesinde incelenmesi, 2021.

Bildiriler

Yönetilen Tezler

3001 - BAŞLANGIÇ AR-GE, ARAŞTIRMACI, Finans Piyasalarındaki Yatırımcı Ve İşlemcilerin Sınıflandırılması, Tespiti Ve Analizi, Yürütülen Kuruluş: İŞLETME MÜHENDİSLİĞİ BÖLÜMÜ, Destek Alınan Kuruluş: TÜBİTAK BAŞKANLIK (Yurt İçi) (Devam ediyor) .

UYGULAMALI ARAŞTIRMA, PROJE YÜRÜTÜCÜSÜ, Yüksek-frekanslı işlemlerin (HFT) piyasa mekanizmaları, piyasa aktörleri ve sosyal refah üzerindeki etkilerinin ortaya konması ile detaylı bir HFT yönetim planı oluşturulması, Yürütülen Kuruluş: KADİR HAS ÜNİVERSİTESİ, Destek Alınan Kuruluş: TÜBİTAK BAŞKANLIK (Yurt İçi) (Devam ediyor) .

TÜBİTAK Burs ve Destekleri

Proje Bilgileri

117K908, Finans Piyasalarındaki Yatırımcı ve İşlemcilerin Sınıflandırılması, Tespiti ve Analizi, 3001 - Başlangıç AR-GE, Araştırmacı/Uzman, Sonuçlandı, ARDEB, SOBAG - Sosyal Ve Beşeri Bilimler Araştırma Destek Grubu, Projeye Katılma/Ayrılma Tarihleri: 04.01.2018 - 01.06.2019, Proje Başlangıç/Bitiş Tarihleri: 01.12.2017 - 01.06.2019.

218K566, Yüksek-Frekanslı İşlemlerin (Hft) Piyasa Mekanizmaları, Piyasa Aktörleri ve Sosyal Refah Üzerindeki Etkilerinin Ortaya Konması ile Detaylı Bir Hft Yönetim Planı Oluşturulması, 3501 - Kariyer, Yürütücü, Sonuçlandı, ARDEB, SOBAG - Sosyal Ve Beşeri Bilimler Araştırma Destek Grubu, Projeye Katılma/Ayrılma Tarihleri: 01.11.2019 - 01.05.2022, Proje Başlangıç/Bitiş Tarihleri: 01.11.2019 - 01.05.2022.

122K637, Finansal Piyasalardaki Özel Bilgi Kaynaklı İşlem Olasılığı Modellerinin Tahminine Yönelik İyileştirmeler, 1002 - Hızlı Destek, Yürütücü, Yürürlükte, ARDEB, SOBAG - Sosyal Ve Beşeri Bilimler Araştırma Destek Grubu, Projeye Katılma/Ayrılma Tarihleri: 01.10.2022 - 01.01.2023, Proje Başlangıç/Bitiş Tarihleri: 01.10.2022 - 01.01.2023.

121K917, Depremlerin Finansal Karar Alma Üzerindeki Etkileri, 1001 - Araştırma, Yürütücü, Yürürlükte, ARDEB, SOBAG - Sosyal Ve Beşeri Bilimler Araştırma Destek Grubu, Projeye Katılma/Ayrılma Tarihleri: 01.02.2022 - 01.02.2025, Proje Başlangıç/Bitiş Tarihleri: 01.02.2022 - 01.02.2025.