

## Prof.Dr. ŞAHAP KASIRGA YILDIRAK

### Kişisel Bilgiler

İş Telefonu: [+90 312 297 6160](tel:+903122976160)

Fax Telefonu: [+90 312 297 6160](tel:+903122976160)

E-posta: [kasirga@hacettepe.edu.tr](mailto:kasirga@hacettepe.edu.tr)

### Eğitim Bilgileri

Doktora, Orta Doğu Teknik Üniversitesi, Ekonomi, Türkiye 2000 - 2004

Yüksek Lisans, North Carolina State University, Economics, Amerika Birleşik Devletleri 1996 - 1999

Lisans, Ankara Üniversitesi, Sbf, İktisat, Türkiye 1985 - 1992

### Araştırma Alanları

Sosyal ve Beşeri Bilimler, Ekonometri, Finans Ekonomisi, Aktüerya

### Akademik Unvanlar / Görevler

Prof.Dr., Hacettepe Üniversitesi, Fen Fakültesi, Aktüerya Bilimleri Bölümü, 2019 - Devam Ediyor

### Akademik İdari Deneyim

Hacettepe Üniversitesi, Fen Fakültesi, Aktüerya Bilimleri Bölümü, 2014 - Devam Ediyor

Hacettepe Üniversitesi, Fen Fakültesi, Aktüerya Bilimleri Bölümü, 2014 - Devam Ediyor

Trakya Üniversitesi, İktisadi Ve İdari Bilimler Fakültesi, İktisat Bölümü, 2005 - 2012

### Yönetilen Tezler

YILDIRAK Ş. K. , Demand, supply and partial equilibrium analysis of Turkish electricity energy pricing, Yüksek Lisans, A.ÖZDEMİR(Öğrenci), 2013

YILDIRAK Ş. K. , Effects of monetary policy on banking interest rates: Interest rate pass-through in Turkey, Yüksek Lisans, S.SAĞIR(Öğrenci), 2011

YILDIRAK Ş. K. , Pricing power derivatives: Electricity swing options, Yüksek Lisans, N.SERHAN(Öğrenci), 2010

YILDIRAK Ş. K. , Petrol sektöründe risk analizi, Yüksek Lisans, M.YAŞA(Öğrenci), 2010

YILDIRAK Ş. K. , A market model for pricing inflation indexed bonds with jumps incorporation, Yüksek Lisans, İ.ETHEM(Öğrenci), 2008

YILDIRAK Ş. K. , Statistical methods in credit rating, Yüksek Lisans, Ö.SEZGİN(Öğrenci), 2006

### SCI, SSCI ve AHCI İndekslerine Giren Dergilerde Yayınlanan Makaleler

#### I. COVID-19 Vaccination Scenarios: A Cost-Effectiveness Analysis for Turkey

Hagens A., İnkaya A. Ç. , Yildirak K., Sancar M., van der Schans J., Acar Sancar A., Ünal S., Postma M., Yeğenoğlu S.

VACCINES, cilt.9, sa.4, 2021 (SCI İndekslerine Giren Dergi)

- II. **Spatiotemporal interpolation through an extension of differential evolution algorithm for agricultural insurance claims**  
NEVRUZ E., YILDIRAK Ş. K.  
JOURNAL OF COMPUTATIONAL AND APPLIED MATHEMATICS, cilt.352, ss.278-292, 2019 (SCI İndekslerine Giren Dergi)
- III. **Optimal investment strategy and liability ratio for insurer with Levy risk process**  
ÖZALP M. A. , Yildirak K., Okur Y. Y.  
HACETTEPE JOURNAL OF MATHEMATICS AND STATISTICS, cilt.48, sa.4, ss.1232-1249, 2019 (SCI İndekslerine Giren Dergi)
- IV. **Adjusting SPI for crop specific agricultural drought**  
Yildirak K., Selcuk-Kestel A. S.  
ENVIRONMENTAL AND ECOLOGICAL STATISTICS, cilt.22, sa.4, ss.681-691, 2015 (SCI İndekslerine Giren Dergi)
- V. **Bayesian estimation of crop yield function: drought based wheat prediction model for tigem farms**  
Yildirak K., Kalaylioglu Z., Mermer A.  
ENVIRONMENTAL AND ECOLOGICAL STATISTICS, cilt.22, sa.4, ss.693-704, 2015 (SCI İndekslerine Giren Dergi)
- VI. **Qualitative determinants and credit-default risk: Evidence from Turkey**  
Yildirak K., Suer O.  
Actual Problems of Economics, cilt.145, sa.7, ss.333-344, 2013 (SCI Expanded İndekslerine Giren Dergi)
- VII. **A REVIEW OF MARKET RISK MEASURES AND COMPUTATION TECHNIQUES**  
Yildirak K., Ekinci C. E.  
RETHINKING VALUATION AND PRICING MODELS: LESSONS LEARNED FROM THE CRISIS AND FUTURE CHALLENGES, ss.283-302, 2013 (SSCI İndekslerine Giren Dergi)
- VIII. **HIGH-FREQUENCY PERFORMANCE OF VALUE AT RISK AND EXPECTED SHORTFALL: EVIDENCE FROM ISE30 INDEX FUTURES**  
Ekinci C. E. , Yildirak K., Taylan A. S.  
RETHINKING VALUATION AND PRICING MODELS: LESSONS LEARNED FROM THE CRISIS AND FUTURE CHALLENGES, ss.303-315, 2013 (SSCI İndekslerine Giren Dergi)
- IX. **A classification problem of credit risk rating investigated and solved by optimisation of the ROC curve**  
Kurum E., Yildirak K., Weber G.  
CENTRAL EUROPEAN JOURNAL OF OPERATIONS RESEARCH, cilt.20, sa.3, ss.529-557, 2012 (SCI İndekslerine Giren Dergi)
- X. **INDEMNITY PAYMENTS IN AGRICULTURAL INSURANCE: RISK EXPOSURE OF EU STATES**  
Yildirak K., GÜLSEVEN O.  
ACTUAL PROBLEMS OF ECONOMICS, sa.127, ss.381-388, 2012 (SSCI İndekslerine Giren Dergi)

## **Diğer Dergilerde Yayınlanan Makaleler**

- I. **CREDIT SCORING BY USING GENERALIZED MODELS: AN IMPLEMENTATION ON TURKEY'S SMEs**  
İŞCANOĞLU ÇEKİÇ A., YILDIRAK Ş. K.  
Journal of Economics, Finance and Accounting, cilt.4, sa.2, ss.98-105, 2017 (Diğer Kurumların Hakemli Dergileri)
- II. **Assessment of Index-based Drought Insurance**  
EVKAYA Ö. O. , YILDIRAK Ş. K. , KESTEL A. S.  
Ekonomik Yaklaşım, cilt.28, sa.105, ss.1-18, 2017 (Diğer Kurumların Hakemli Dergileri)
- III. **Türkiye de Buğday Bitkisel Ürün Sigortası için Aktüeryal Prim Hesabı**  
ŞAHİN Ş., KARABEY U., BULUT KARAGEYİK B., NEVRUZ E., YILDIRAK Ş. K.  
Tarım Ekonomisi Dergisi, cilt.22, ss.37-47, 2016 (Diğer Kurumların Hakemli Dergileri)
- IV. **Choosing the Appropriate Amount of Mortgage Loan Risk Based Decision Making**  
GÜNAY S. G. , YILDIRAK Ş. K.

- International Journal of Economics and Finance, cilt.8, sa.11, ss.12-29, 2016 (Diğer Kurumların Hakemli Dergileri)
- V. **AN ALTERNATIVE APPROACH TO ANALYZE THE MONETARY TRANSMISSION IN TURKEY: AN EMPIRICAL ANALYSIS ON SPEED OF ADJUSTMENT**  
UÇAK A., YILDIRAK Ş. K.  
Finansal Araştırmalar ve Çalışmalar Dergisi, cilt.3, sa.7, 2012 (Diğer Kurumların Hakemli Dergileri)
- VI. **Do we adequately respect the potential of routine primary health care services in reducing neonatal mortality in developing countries? The example of the Denizli cohort.**  
ÜNER S., Cakir B., Yildirak K.  
Cahiers de sociologie et de demographie medicales, cilt.50, sa.4, ss.477-99, 2010 (Diğer Kurumların Hakemli Dergileri)
- VII. **Financial Regression and Organization, in the Special Issue on Optimization in Finance**  
YILDIRAK Ş. K. , taylan p., weber g. w.  
Dynamics of Continuous, Discrete and Impulsive Systems (Series B)), cilt.17, ss.149-174, 2010 (Diğer Kurumların Hakemli Dergileri)
- VIII. **Time varying Beta Risk of Turkish Real Estate Investment Trusts**  
gözde a., EROL I., YILDIRAK Ş. K.  
Metu Studies in Development, sa.37, ss.83-114, 2010 (Diğer Kurumların Hakemli Dergileri)

## Kitap & Kitap Bölümleri

- I. **Review of Market Risk Computation Techniques**  
YILDIRAK Ş. K. , EKİNCİ C. E.  
Review of Market Risk Computation Techniques Rethinking Valuation and Pricing Models Lessons Learned from the Crisis and Future Challenges Elsevier 2013, Carsten Wehn, Christian Hoppe and Greg N. Gregoriou, Editör, elsevier, ss.283-302, 2013
- II. **High-Frequency Performance of Value at Risk and Expected Shortfall: Evidence from ISE30 Index Futures**  
EKİNCİ C. E. , YILDIRAK Ş. K. , Ali Sabri T.  
Rethinking Valuation and Pricing Models, Carsten Wehn, Christian Hoppe and Greg N. Gregoriou , Editör, elsevier, ss.303-3015, 2013
- III. **Türev Ürün Fiyatlandırma Teknikleri**  
YILDIRAK Ş. K. , çetinkaya ş., çalışkan n.  
Literatür, 2008

## Hakemli Kongre / Sempozyum Bildiri Kitaplarında Yer Alan Yayınlar

- I. **Kopulalar Aracılığıyla Kümeleme Yöntemi: Mortalite Riski Tahmininde Kullanılacak Değişkenlerin Seçimi**  
İLHAN Z., YILMAZ V., YILDIRAK Ş. K.  
20. Uluslararası Ekonometri, Yöneylem Araştırması ve İstatistik Sempozyumu, 12 - 14 Şubat 2020
- II. **Akut gastroenterit salgınlarına yönelik günlük yağış miktarına göre erken uyarı sistemi modellenmesi**  
TELATAR T. G. , YILDIRAK Ş. K. , ÜNER S.  
3. Uluslararası 21. Ulusal Halk Sağlığı, Antalya, Türkiye, 26 - 30 Kasım 2019, ss.334-335
- III. **Risk Classification with Artificial Neural Networks Models in Motor Third Party Liability**  
YILDIRAK Ş. K. , KESTEL A. S. , GÜR İ.  
International Conference on Data Science, Machine Learning and Statistics - 2019(DMS-2019), Van, Türkiye, 26 - 29 Haziran 2019
- IV. **Toplam Hasar Fazlası Sıralandırma Bağıntısı Altında Beklenen Fayda Kuramı ile Kümülatif Beklenti Teorisinin Karşılaştırılması**

NEVRUZ E., YILDIRAK Ş. K. , SENGUPTA A.

Ulusal Sigorta ve Aktüerya Kongresi (USAK) 2019, Türkiye, 24 - 25 Haziran 2019

- V. **Actuarial Premium Calculation by Using Multi-Stage Clustering in Agricultural Insurance**  
YILDIRAK Ş. K. , GÜR İ., SENGUPTA A.  
19. Uluslararası Ekonometri, Yöneylem Araştırması ve İstatistik (EYİ 2018) Sempozyumu, Antalya, Türkiye, 17 - 20 Ekim 2018
- VI. **Cluster-Based Multivariate Stochastic Prioritization of Dependent Actuarial Risks in Crop-Hail Insurance**  
NEVRUZ E., YILDIRAK Ş. K. , SENGUPTA A.  
EAJ 2018: 4 th European Actuarial Journal Conference, Leuven, Belçika, 10 - 11 Eylül 2018
- VII. **Multivariate Stochastic Prioritization of Dependent Actuarial Risks in Agricultural Insurance**  
NEVRUZ E., YILDIRAK Ş. K. , SENGUPTA A.  
ASTIN and AFIR/ERM Colloquia 2017, PANAMA CITY, Panama, 20 - 24 Ağustos 2017
- VIII. **Optimal Investment and Insurance Policy for an Insurer with Random Size Jump-Diffusion Risk process**  
Özalp M. A. , Yıldırak Ş. K. , Yolcu Okur Y.  
21. International Congress on Insurance: Mathematics and Economics, Vienna, Avusturya, 3 - 05 Temmuz 2017
- IX. **Risk Classification in Agricultural Insurance under Dependency Assumption**  
NEVRUZ E., YILDIRAK Ş. K.  
3rd International Researchers, Statisticians and Young Statisticians Congress, Konya, Türkiye, 24 - 26 Mayıs 2017
- X. **Frost Risk Premium Calculation Using Spatial Clustering**  
GÜR İ., YILDIRAK Ş. K. , LAZOĞLU Ç.  
3ND INTERNATIONAL RESEARCHERS, STATISTICIANS AND YOUNG STATISTICIANS CONGRESS (IRSYSC 2017), Konya, Türkiye, 24 - 26 Mayıs 2017
- XI. **Prioritization of Dependent Actuarial Risks: Stochastic Majorization**  
NEVRUZ E., YILDIRAK Ş. K.  
Innovations in Insurance, Risk- and Asset Management Conference, Munich, Almanya, 5 - 07 Nisan 2017
- XII. **Stochastic Prioritisation of Dependent Actuarial Risks Preferences Among Prospects**  
NEVRUZ E., YILDIRAK Ş. K. , SENGUPTA A.  
ICASQF 2016: 18th International Conference on Actuarial Science and Quantitative Finance, Amsterdam, Hollanda, 1 - 02 Aralık 2016, ss.240
- XIII. **How Effective Is Scr When The Association Is Measured With Copulas**  
HASGÜL E., KESTEL A. S. , YILDIRAK Ş. K.  
9th International Statistics Congress, 28 Ekim - 01 Kasım 2015
- XIV. **Bir Sigorta Şirketi İçin Optimal Yatırım Stratejisinin ve Optimal Yükümlülük Oranın Hamilton Jacobi Bellman Metodu ile Belirlenmesi**  
ASIM O., YILDIRAK Ş. K.  
2. Ulusal Sigorta ve Aktüerya Kongresi, Türkiye, 17 - 18 Eylül 2015
- XV. **Stochastic Mortality Models Cross Country Comparison**  
çatinkaya ş., YILDIRAK Ş. K.  
16th International Symposium on Econometrics, Operations Research and Statistics, 7 - 12 Ekim 2015

## Desteklenen Projeler

YILDIRAK Ş. K. , ÖZALP M. A. , NEVRUZ E., Yükseköğretim Kurumları Destekli Proje, Tarım Sigortası Portföyünde Risk Önceliklendirme ve Değerleme Çalışması, 2018 - 2018

YILDIRAK Ş. K. , NEVRUZ E., Yükseköğretim Kurumları Destekli Proje, Bağımlı Aktüeryal Risklerin Önceliklendirilmesi: Stokastik Baskılama, 2017 - 2017

YILDIRAK Ş. K. , TATLIDİL H. H. , ERDEMİR Ö. G. , Yükseköğretim Kurumları Destekli Proje, Hayat-Dışı Sigorta Şirketlerinin Performans Ölçüm Yöntemi Olarak Temel Bileşen Analizi, 2016 - 2017

YILDIRAK Ő. K. , NEVRUZ E., SENGUPTA A., YksekĖretim Kurumları Destekli Proje, BaĖımlı Akteryal Risklerin Stokastik nceliklendirilmesi Beklentiler Arasındaki Tercihler, 2016 - 2016

YILDIRAK Ő. K. , YksekĖretim Kurumları Destekli Proje, Parametrik Olmayan İstatistik alıřtayı, 2016 - 2016

YILDIRAK Ő. K. , KARATAŐ R., ERDEMİR . G. , KIRKAĖA M., ŐENTRK ACAR A., NEVRUZ E., BULUT KARAGEYİK B., ARIK A., KARAGL B. Z. , ŐİMŐEK G., et al., YksekĖretim Kurumları Destekli Proje, II. Ulusal Sigorta ve Akterya Kongresi, 2015 - 2016

YILDIRAK Ő. K. , BULUT KARAGEYİK B., ERDEMİR . G. , ŐAHİN Ő., KARABEY U., NEVRUZ E., YksekĖretim Kurumları Destekli Proje, Tarım Sigortaları ve Tarımda DoĖal Afet Ynetiminin EtkinliĖinin DeĖerlendirilmesi, 2015 - 2016

Yıldırak Ő. K. , DiĖer Resmi Kurumlarca Desteklenen Proje, Trkiye Hayat Tabloları Yenileme, 2015 - 2016

## Atıflar

Toplam Atıf Sayısı (WOS):14

h-indeksi (WOS):2