

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

Web: <https://avesis.hacettepe.edu.tr/kasirga>

Uluslararası Araştırmacı ID'leri

ORCID: 0000-0002-0797-3505

ScopusID: 37058225600

Yoksis Araştırmacı ID: 60797

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

Yabancı Diller

İngilizce, C2 Ustalık

Araştırma Alanları

Ekonometri, Finans Ekonomisi, Aktüerya, İstatistik Analiz ve Uygulamaları

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

Yıldırak Ş. K., Impacts of spatiotemporal dependency and asymmetric information on the analysis of optimal crop yield insurance, Doktora, G.ŞİMŞEK(Öğrenci), 2020

Yıldırak Ş. K., Çetin M., Türkiye'de gün öncesi piyasası için elektrik fiyatlarının tahmini, Yüksek Lisans,

S.DEMİREZEN(Öğrenci), 2020

- Yıldırak Ş. K., Yılmaz V., Kopula temelli değişken kümeleme tekniklerinin incelenmesi ve mortalite tahmini uygulaması, Doktora, Z.İLHAN(Öğrenci), 2019
- Yıldırak Ş. K., Kasko sigortasında makine öğrenmesi yöntemleri ile hasarlı/hasarsız durum tahmini, Yüksek Lisans, S.KİLİSLİ(Öğrenci), 2019
- Yıldırak Ş. K., Multivariate stochastic prioritization of dependent actuarial risks under uncertainty, Doktora, E.NEVRUZ(Öğrenci), 2018
- Yıldırak Ş. K., Tarım sigortalarında dolu riskinin kümelenmesi ve toplam hasar dağılımının Hızlı Fourier Dönüşümü ile belirlenmesi, Yüksek Lisans, V.KISA(Öğrenci), 2018
- Yıldırak Ş. K., Sigorta sektörünün kredi portföy risk modeli ile değerlendirilmesi, Yüksek Lisans, M.ERKAN(Öğrenci), 2018
- Yıldırak Ş. K., Tarım sigortalarında konumsal kümeleme üzerine bir çalışma, Yüksek Lisans, İ.GÜR(Öğrenci), 2017
- Yıldırak Ş. K., Determination of the optimal investment and liability for an insurer with dynamic programming, Yüksek Lisans, M.ASIM(Öğrenci), 2015
- 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., Petrol sektöründe risk analizi, Yüksek Lisans, M.YAŞA(Öğrenci), 2010
- YILDIRAK Ş. K., Pricing power derivatives: Electricity swing options, Yüksek Lisans, N.SERHAN(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-Expanded)
- 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-Expanded)
- 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-Expanded)
- 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-Expanded)
- 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-Expanded)
- 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)
- 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)
- 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)

- 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-Expanded)
- 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)

Diğer Dergilerde Yayınlanan Makaleler

- I. **An enhanced random forest approach using CoClust clustering: MIMIC-III and SMS spam collection application**
İLHAN TAŞKIN Z., YILDIRAK Ş. K., ALADAĞ Ç. H.
JOURNAL OF BIG DATA, cilt.10, sa.1, 2023 (Scopus)
- II. **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 (Hakemli Dergi)
- III. **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 (Hakemli Dergi)
- IV. **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 (Hakemli Dergi)
- V. **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 (Hakemli Dergi)
- VI. **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 (Hakemli Dergi)
- VII. **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 (Scopus)
- VIII. **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 (Scopus)
- IX. **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 (Hakemli Dergi)

Kitap & Kitap Bölümleri

- I. **Wind Speed and Wind Direction Prediction: An Implementation of a Deep Learning Algorithm Enriched by SWT and Circular PCA**
Yıldirak Ş. K.
Directional Statistics for Innovative Applications A Bicentennial Tribute to Florence Nightingale, Ashis

Sengupta, Barry C. Arnold, Editör, Springer Nature, Singapore, ss.475-488, 2022

II. 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

III. 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

IV. Türev Ürün Fiyatlama 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 modellemesi

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., Yıldırak 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 Oranının 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., TÜBİTAK Projesi, Aktüeryal Dolu Riski Haritası, 2019 - 2020
- 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 Ş. K., NEVRUZ E., SENGUPTA A., Yükseköğretim Kurumları Destekli Proje, Bağımlı Aktüeryal Risklerin Stokastik Önceliklendirilmesi Beklentiler Arasındaki Tercihler, 2016 - 2016
- YILDIRAK Ş. K., Yükseköğretim Kurumları Destekli Proje, Parametrik Olmayan İstatistik Çalıştayı, 2016 - 2016
- YILDIRAK Ş. K., KARATAŞ R., ERDEMİR Ö. G., KIRKAĞAÇ M., ŞENTÜRK ACAR A., NEVRUZ E., BULUT KARAGEYİK B., ARIK A., KARAGÜL B. Z., ŞİMŞEK G., et al., Yükseköğretim Kurumları Destekli Proje, II. Ulusal Sigorta ve Aktüerya Kongresi, 2015 - 2016
- YILDIRAK Ş. K., BULUT KARAGEYİK B., ERDEMİR Ö. G., ŞAHİN Ş., KARABEY U., NEVRUZ E., Yükseköğretim Kurumları Destekli Proje, Tarım Sigortaları ve Tarımda Doğal Afet Yönetiminin Etkinliğinin Değerlendirilmesi, 2015 - 2016
- Yıldırak Ş. K., Diğer Resmi Kurumlarca Desteklenen Proje, Türkiye Hayat Tabloları Yenileme, 2015 - 2016

Metrikler

- Yayın: 40
Atıf (WoS): 54
Atıf (Scopus): 59
H-İndeks (WoS): 4
H-İndeks (Scopus): 4