Doç.Dr. ŞULE ŞAHİN

Kişisel Bilgiler

İş Telefonu: +90 312 297 6160 Dahili: 129
E-posta: sule@hacettepe.edu.tr
Web: http://www.aktuerya.hacettepe.edu.tr/pers/SuleSahin.php
Posta Adresi: Hacettepe Üniversitesi Beytepe Kampüsü Aktüerya Bilimleri Bölümü

Eğitim Bilgileri

Doktora, Heriot-Watt University, Mathematical And Computer Sciences, Actuarial Mathematics, Birleşik Krallık 2007 - 2010
Yüksek Lisans, Orta Doğu Teknik Üniversitesi, Fen Edebiyat Fakültesi, Sosyoloji, Türkiye 2004 - 2008
Yüksek Lisans, Hacettepe Üniversitesi, Fen Fakültesi, Aktüerya Bilimleri, Türkiye 2004 - 2006
Lisans Yandal, Orta Doğu Teknik Üniversitesi, Fen Edebiyat Fakültesi, Sosyoloji, Türkiye 2002 - 2004
Lisans, Orta Doğu Teknik Üniversitesi, Fen Edebiyat Fakültesi, İstatistik, Türkiye 1999 - 2004

Yaptığı Tezler

Yüksek Lisans, Transformation of the Turkish welfare regime: The role of the individual pension system and its effect on women's welfare, Orta Doğu Teknik Üniversitesi, Fen-Edebiyat Fakültesi, Ortodonti A.B.D., 2008
Yüksek Lisans, Belirlenmiş fayda emeklilik planlarından belirlenmiş katkı emeklilik planlarına geçişin modellenmesi: Türkiye uygulaması, Hacettepe Üniversitesi, Fen Fakültesi, Aktüerya Bilimleri Bölümü, 2006

Araştırma Alanları

İstatistik, Temel Bilimler

Verdiği Dersler

AKTÜERYA, Lisans, 2016 - 2017
ÖZEL KONULAR, Doktora, 2016 - 2017
Demografi ve Yaşam Modelleri, Lisans, 2016 - 2017
ÖZEL KONULAR, Yüksek Lisans, 2016 - 2017
ZAMAN SERİLERİ, Doktora, 2016 - 2017

SCI, SSCI ve AHCI İndekslerine Giren Dergilerde Yayınlanan Makaleler

I. **Transitory mortality jump modeling with renewal process and its impact on pricing of catastrophic bonds**
   Ozen S., Sahin S.
   JOURNAL OF COMPUTATIONAL AND APPLIED MATHEMATICS, cilt.376, 2020 (SCI-Expanded)
II. **PARSIMONIOUS PARAMETERIZATION OF AGE-PERIOD-COHORT MODELS BY BAYESIAN SHRINKAGE**

Venter G., ŞAHİN Ş.
ASTIN BULLETIN, cilt.48, sa.1, ss.89-110, 2018 (SCI-Expanded)

III. **Pricing pension buy-outs under stochastic interest and mortality rates**
ARIK A., Yolcu-Okur Y., ŞAHİN Ş., UĞUR Ö.
SCANDINAVIAN ACTUARIAL JOURNAL, sa.3, ss.173-190, 2018 (SCI-Expanded)

IV. **Optimal lower barrier on modified surplus process**
BULUT KARAGEYİK B., ŞAHİN Ş.
JOURNAL OF STATISTICAL COMPUTATION AND SIMULATION, cilt.87, sa.8, ss.1520-1540, 2017 (SCI-Expanded)

V. **HOW A SINGLE-FACTOR CAPM WORKS IN A MULTI-CURRENCY WORLD**
Thomson R., ŞAHİN Ş., Reddy T.
ASTIN BULLETIN, cilt.46, sa.1, ss.103-139, 2016 (SCI-Expanded)

VI. **A Minimum Pension Guarantee Application for the Individual Pension System in Turkey: A Gendered Approach**
ŞAHİN Ş., Elveren A. Y.
JOURNAL OF WOMEN POLITICS & POLICY, cilt.35, sa.3, ss.242-270, 2014 (SSCI)

Diğer Dergilerde Yayınlanan Makaleler

I. **Semiparametric Regression for Dual Population Mortality**
Venter G., Şahin Ş.
North American Actuarial Journal, cilt.26, sa.3, ss.403-427, 2022 (ESCI)

II. **Yet more on a stochastic economic model: Supplement to Part 4: A model for share earnings, dividends and prices**
Wilkie A. D., Sahin S.
ANNALS OF ACTUARIAL SCIENCE, cilt.14, sa.1, ss.138-149, 2020 (ESCI)

III. **Yet more on a stochastic economic model: Part 5: a vector autoregressive (VAR) Model for retail prices and wages**
Wilkie A. D., Sahin S.
ANNALS OF ACTUARIAL SCIENCE, cilt.13, sa.1, ss.92-108, 2019 (ESCI)

IV. **THE FORCE OF RUIN**
ŞAHİN Ş., BULUT KARAGEYİK B.
SIGMA JOURNAL OF ENGINEERING AND NATURAL SCIENCES-SIGMA MUHENDISLIK VE FEN BILIMLERI DERGISI, cilt.36, sa.2, ss.563-575, 2018 (ESCI)

V. **Yet more on a stochastic economic model: Part 4: a model for share earnings, dividends, and prices**
Wilkie A. D., ŞAHİN Ş.
ANNALS OF ACTUARIAL SCIENCE, cilt.12, sa.1, ss.67-105, 2018 (ESCI)

VI. **Yet more on a stochastic economic model: Part 3A: stochastic interpolation: Brownian and Ornstein-Uhlenbeck (OU) bridges**
Wilkie A. D., ŞAHİN Ş.
ANNALS OF ACTUARIAL SCIENCE, cilt.11, sa.1, ss.74-99, 2017 (ESCI)

VII. **Optimal Retention Level for Infinite Time Horizons under MADM**
BULUT KARAGEYİK B., ŞAHİN Ş.
RISKS, cilt.5, sa.1, 2017 (ESCI)

VIII. **Determination of the Optimal Retention Level Based on Different Measures**
BULUT KARAGEYİK B., ŞAHİN Ş.
JOURNAL OF RISK AND FINANCIAL MANAGEMENT, cilt.10, sa.1, 2017 (ESCI)

IX. **Yet more on a stochastic economic model: Part 3C: stochastic bridging for share yields and dividends and interest rates**
Wilkie A. D., ŞAHİN Ş.
ANNALS OF ACTUARIAL SCIENCE, cilt.11, sa.1, ss.128-163, 2017 (ESCI)

X. **Yet more on a stochastic economic model: Part 3B: stochastic bridging for retail prices and wages**
Wilkie A. D., ŞAHİN Ş.
ANNALS OF ACTUARIAL SCIENCE, cilt.11, sa.1, ss.100-127, 2017 (ESCI)

XI. **Yet more on a stochastic economic model: part 2: initial conditions, select periods and neutralising parameters**
Wilkie A. D., ŞAHİN Ş.
ANNALS OF ACTUARIAL SCIENCE, cilt.10, sa.1, ss.1-51, 2016 (ESCI)

XII. **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)

XIII. **Pricing Turkish longevity risk**
KARABEY U., ŞAHİN Ş., ARIK A.
International Journal of Ecological Economics and Statistics, cilt.37, sa.2, ss.46-55, 2016 (ESCI)

XIV. **A Yield-Macro Model for Actuarial Use in the United Kingdom**
ŞAHİN Ş., Cairns A. J., Kleinow T., Wilkie A. D.
Annals of Actuarial Science, cilt.8, sa.2, ss.320-350, 2014 (ESCI)

XV. **Dynamic social security after the crisis: Towards a new welfare state?**
Diamond P., Lodge G.
International Social Security Review, cilt.67, ss.37-59, 2014 (Scopus)

XVI. **A Yield-Only Model for the Term Structure of Interest Rates**
ŞAHİN Ş., Cairns A. J., Kleinow T., Wilkie A. D.
Annals of Actuarial Science, cilt.8, sa.1, ss.99-130, 2013 (ESCI)

XVII. **Assessing a minimum pension guarantee for the voluntary IPS in Turkey**
ŞAHİN Ş., Elveren A.
INTERNATIONAL SOCIAL SECURITY REVIEW, cilt.64, sa.3, ss.39-61, 2011 (ESCI)

XVIII. **Yet More on a Stochastic Economic Model: Part 1: Updating and Refitting, 1995 to 2009"**
ŞAHİN Ş., Wilkie A. D., Cairns A. J., Kleinow T.
Annals of Actuarial Science, cilt.5, sa.1, ss.53-99, 2010 (ESCI)

XIX. **The Individual Pension System in Turkey: A Gendered Perspective**
ŞAHİN Ş., Elveren A. Y., Rittersberger-Tılıç H.
Ekonomik Yaklaşım, cilt.21, ss.115-142, 2010 (Scopus)

Hakemli Kongre / Sempozyum Bildiri Kitaplarında Yer Alan Yayınlar

I. **On the Pension Buy out Pricing in Presence of Stochastic Interest and Mortality Rates**
ARIK A., ŞAHİN Ş., YOLCU OKUR Y.
The Joint Colloquium of the IACA, PBSS and IAAHS Section of the International Actuarial Association, 27 - 29 Haziran 2016

II. **Enflasyon Riskinin Anüite Fiyatlamasına Etkileri**
KARABEY U., ŞAHİN Ş.
2. Ulusal Sigortacılık ve Aktüerya Kongresi, Türkiye, 17 - 18 Eylül 2015

III. **Pension Buy out Ürünlerinin Bağımlılık Varsayımı Altında Fiyatlandırılması**
ARIK A., YOLCU OKUR Y., ŞAHİN Ş.
2. Ulusal Sigorta ve Aktüerya Kongresi, Ankara, Türkiye, 17 - 18 Eylül 2015

IV. **Pricing Pension Buy outs under Dependence Assumption**
ARIK A., YOLCU OKUR Y., ŞAHİN Ş.
Longevity 11 – The eleventh international longevity risk and capital markets solutions, Lyon, Fransa, 7 - 09 Eylül 2015

V. **Quantification of Inflation Risk on the Annuities**
KARABEY U., ŞAHİN Ş.

19th International Congress on Insurance: Mathematics and Economics, 24 - 26 Haziran 2015

VI. **Risk measurement of the future annutiy prices effects of different interest rate models**
KARABEY U., ŞAHİN Ş.
11th Applied Statistics 2014, 21 - 24 Eylül 2014

VII. **Assesing the Effect of Interest Rate Models on the Future Annuity Prices**
KARABEY U., ŞAHİN Ş.
18th International Congress on Insurance: Mathematics and Economics, 10 - 12 Temmuz 2014

VIII. **A Comparison of the GARCH Models and Extreme Value Theory in terms of Risk Measures for Emerging Markets**
Nevruz E., Şahin Ş.
The 18th International Congress on Insurance: Mathematics and Economics, Shanghai, Çin, 10 - 12 Temmuz 2014, ss.141

IX. **Impact of Different Investment Strategies on Pricing of Pension Bulk Annuities**
ARIK A., ŞAHİN Ş.
The 18th International Congress on Insurance: Mathematics&Economics, Shanghai, Çin, 10 - 12 Temmuz 2014

X. **Selecting the Best Pricing Model to Conform to a Country s Avaliable Data**
KARABEY U., ŞAHİN Ş., ARIK A.
30th International Congress of Actuaries, 30 Mart - 04 Nisan 2014

XI. **Selecting the Best Pricing Model to Conform to a Country s Available Data**
KARABEY U., ŞAHİN Ş., ARIK A.
30th International Congress of Actuaries, Washington, Kiribati, 30 Mart - 04 Nisan 2014

Desteklenen Projeler

ŞAHİN Ş., WİLKİE A. D., Yükseköğretim Kurumları Destekli Proje, Hisse Senedi Getirileri, Fiyatları ve Temettü Ödemelerinin Modellenmesi, 2017 - 2017

BULUT KARAGEYİK B., ŞAHİN Ş., Yükseköğretim Kurumları Destekli Proje, Farklı Ölçümler Altında Optimal Saklama Payı Seviyesinin Belirlenmesi, 2017 - 2017

ŞAHİN Ş., BULUT KARAGEYİK B., Yükseköğretim Kurumları Destekli Proje, İflas Zamanı için Tehlike Fonksiyonu, 2016 - 2016

BULUT KARAGEYİK B., ŞAHİN Ş., Yükseköğretim Kurumları Destekli Proje, Değiştirilmiş Risk Sürecinde Optimal Bariyer Seviyesi, 2016 - 2016

ARIK A., YOLCU OKUR Y., ŞAHİN Ş., Yükseköğretim Kurumları Destekli Proje, Stokastik Faiz ve Ölümlülük Modelleri Yardımıyla Pension Buy-out Ürünlerinin Fiyatlandırılması, 2016 - 2016

ŞAHİN Ş., THOMSON R. J., REDDY T., Yükseköğretim Kurumları Destekli Proje, Farklı Para Birimleri için Tek Faktörlü Varlık Değerleme Modeli, 2016 - 2016

ŞAHİN Ş., ELVEREN A. Y., Yükseköğretim Kurumları Destekli Proje, Türkiye'deki Bireysel Emeklilik Sistemi için Asgari Emeklilik Geliri Garantisi Uygulaması: Toplumsal Cinsiyetçi Bakış Açışı, 2015 - 2016

ARIK A., ŞAHİN Ş., YOLCU OKUR Y., Yükseköğretim Kurumları Destekli Proje, Pension Buy-out ürünlerinin Bağımlılık Varsayımı Altında Fiyatlandırılması, 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

ŞAHİN Ş., THOMSON R., Yükseköğretim Kurumları Destekli Proje, Stokastik İnterpolasyon: Ekonomik Model Uygulaması, 2015 - 2015

KARABEY U., ŞAHİN Ş., Yükseköğretim Kurumları Destekli Proje, Annüitelerde Enflasyon Riskinin Ölçümü, 2015 - 2015

ŞAHİN Ş., THOMSON R. J., Yükseköğretim Kurumları Destekli Proje, Finansal Varlıkları Fiyatlama Modeli, 2015 - 2015

Metrikler

Yayın: 38
Atıf (WoS): 38
Atıf (Scopus): 2
H-İndeks (WoS): 4
H-İndeks (Scopus): 1