



HACETTEPE
ÜNİVERSİTESİ



15 Mayıs, 2025
Perşembe
14:00



Hacettepe Üniversitesi
Matematik Bölümü
Yaşar Ataman Salonu

MATEMATİK BÖLÜMÜ

GENEL SEMİNER

KONUŞMACI

İrfan Okay

Matematik ve Finans Alanında Akademisyen

BAŞLIK

Fikirden Uygulamaya:

Yatırım Stratejilerini Sıfırdan Kurmak ve Hayata Geçirmek

ÖZET

Yatırım stratejisi geliştirme dünyası; matematik ve istatistiğin teknolojiyle birleştiğinde ortaya çıkan eşsiz gücü sergilemek için ideal bir sahnedir. Bu gerçek, her geçen gün daha da belirginleşmekte; yalnızca fiyat eğrisinin matematiksel ve istatistiksel özelliklerine dayanan, insan duyguları ve öznel yargılardan bağımsız niceliksel (quantitative) yatırım stratejilerine yönelik küresel ilgiyi hızla artırmaktadır.

Finansal piyasaların hareketli ortamında iyi bir fikre sahip olmak sadece ilk adımdır; asıl başarı, bu fikri sistemli bir şekilde işleyerek, gerçek dünya koşullarında hem ayakta kalabilen hem de başarıyı sürdürebilen sağlam bir yatırım stratejisine dönüştürebilmektir.

Bu seminer, yatırım stratejisi geliştirmenin tüm yaşam döngüsünü kapsayan kapsamlı ve uygulamalı bir yolculuk sunmaktadır. Seminer boyunca tüm kavramlar; örnek bir stratejinin adım adım canlı olarak tasarlanıp inşa edilmesiyle uygulamalı olarak gösterilecektir. Katılımcılar, strateji tasarımı, test edilmesi ve piyasaya sürülmesi süreçlerini doğrudan deneyimleme fırsatı bulacaktır. Profesyonel strateji geliştirme sürecinin temel yapı taşları ayrıntılı şekilde ele alınacaktır: backtesting (geçmiş veri testleri) ve tarihsel simülasyonlar, sermaye tahsis sanatı, hedging teknikleri ve etkili risk yönetimi uygulamaları. Ayrıca, teorik bilgilerin nasıl gerçek piyasa uygulamalarına dönüştürüleceği de ayrıntılı biçimde açıklanacaktır.

Seminer boyunca matematiksel düşüncenin, istatistiksel analizin ve veri odaklı yaklaşımın; belirsizlikleri yönetmede ve dayanıklı yatırım sistemleri tasarlamada oynadığı hayati rol sürekli vurgulanacaktır.

Seminerin sonunda katılımcılar, yalnızca güçlü bir kavramsal anlayış değil; aynı zamanda yüksek kaliteli bir yatırım ve alım-satım stratejisi geliştirmek ve hayata geçirmek için gereken tüm pratik bilgi ve becerilere aşina olup; kendi stratejilerini geliştirme yolunda önemli bir adım atmış olacaklardır.