



HACETTEPE ÜNİVERSİTESİ MATEMATİK BÖLÜMÜ GENEL SEMİNERİ

(HACETTEPE UNIVERSITY MATHEMATICS GENERAL SEMINAR)

Tarih (Date): 03.04.2019, Çarşamba (Wednesday)

Saat (Time): 15.00

Yer (Place): Yaşar Ataman Seminer Salonu

Konuşmacı (Speaker): Prof. Dr. Hüseyin Merdan, TOBB ETÜ

Başlık (Title): Finansal Piyasalar İçin Deterministik Modeller

Özet (Abstract):

Stokastik modellemelerde kullanılan kabullerin (arbitrage argümanı, vs.) yerine yatırımcıların bir hisse senedini alıp-satarken yaygın olarak dikkate aldığı pratikteki uygulamalar göz önüne alınarak, dinamik sistemler yaklaşımı ile bir hisse senedi fiyatının zamana göre değişimine tahmin veren deterministik matematiksel modellerin çıkarılışları anlatılacaktır. Bu modeller kullanılarak çeşitli şartlar altında bir hisse senedinin (closed-end-funds) zamana bağlı fiyat değişimi tartışılacak ve elde edilen teorik bulgular nümerik simülasyonlar ile desteklenecektir.