



Portföy Analiz Raporu

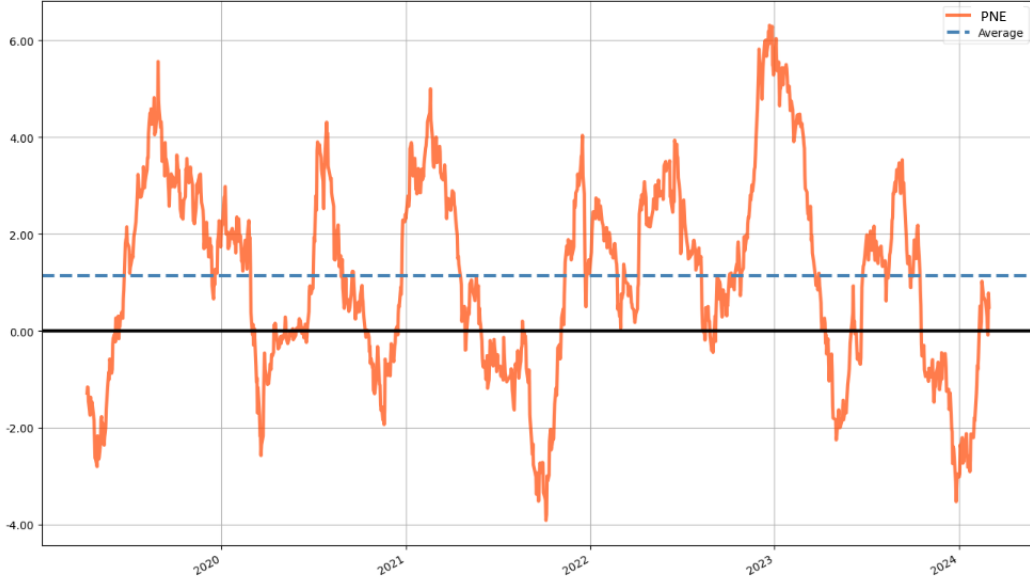
Tarih: 03.03.2024

Müşteri: FONERA A.Ş.

Raportör : Alper Ülkü

Piyasa Nefes Endikatörü

Piyasa Nefes Endeksi (şu anki değeri = 0.8)



Aslında PNE'nin mavi çizgili ortalamayı geçmesi beklenmektedir ancak 31 Mart Yerel Seçimleri ile risklerin artması sebebiyle bu beklenti - sadece bu döneme özel olarak - gerçekçi olmayabilir. Piyasanın mavi çizgiye değip aşağı gitme ihtimali daha yüksek izlenmektedir. Aşağıdaki Markov Olasılıkları bu tezimizi doğrulamaktadır.

Markov Zincir Olasılıkları

Portföyünüze ait Markov Zincir olasılıkları verilmektedir. Bunların tümünün 0.56'dan küçük olması izlenmekte ve aslında downtrend dönemine girmiş olabilecekleri ihtimali kuvvetlenmektedir.

List for Long:

	Ticker	Open-Close	Close	Eff	Pwin_OC	Pwin
0	TAVHL.IS	0.998699	1.393326	0.716774	0.409	0.557
1	ANSGR.IS	1.112058	2.453065	0.453334	0.443	0.530
2	AGHOL.IS	1.406863	1.701415	0.826878	0.451	0.513
3	ISMEN.IS	1.255854	1.969202	0.637748	0.558	0.509
4	BIMAS.IS	0.921918	1.740673	0.529633	0.448	0.505
5	MAVI.IS	0.876389	1.756890	0.498830	0.402	0.504
6	TTKOM.IS	1.449350	1.097425	1.320683	0.579	0.500
7	ASELS.IS	0.995266	1.329247	0.748744	0.392	0.495
8	ENJSA.IS	1.257816	1.353324	0.929427	0.504	0.491
9	TCELL.IS	1.272720	1.318341	0.965395	0.538	0.491
10	ULKER.IS	1.504017	2.147459	0.700371	0.578	0.464
11	XU100.IS	1.013889	1.070071	0.947497	0.598	0.464
12	EKGYO.IS	0.932806	0.886722	1.051971	0.424	0.434
13	THYAO.IS	0.998662	1.225190	0.815107	0.477	0.427

	Ticker	Open-Close	Close	Eff	PWin_OC	PWin ▼
0	KZBGY.IS	1.069262396420986	0.6276028644467195	1.7037245318560226	0.49	0.581
1	AYDEM.IS	0.9674907010366802	1.0826260544347206	0.8936517803849116	0.491	0.576
2	AHGAZ.IS	0.756914092337773	1.219251253458986	0.6208023901475812	0.389	0.575
3	TAVHL.IS	0.9986988483743547	1.393325565846824	0.7167735042365161	0.409	0.557
4	PGSUS.IS	1.3042229451807859	1.0566819192824954	1.2342625736100177	0.482	0.553
5	ODAS.IS	1.6656795568656637	0.8051895955007402	2.0686799310040667	0.585	0.55
6	SNGYO.IS	1.0183874710713776	0.7601440637067971	1.3397295587697837	0.449	0.546
7	PETKM.IS	1.0297563402483771	0.9169623924581545	1.123008259354944	0.442	0.541
8	BUCIM.IS	1.0388082790828215	0.747890665737275	1.3889841479152012	0.513	0.541
9	CCOLA.IS	0.7138887005613729	1.963006824950888	0.3636608347397024	0.345	0.538
10	AKFGY.IS	1.1038235344115044	0.7944996965522676	1.389331599749563	0.53	0.535
11	ISCTR.IS	1.384670507624386	1.69015712599572	0.8192554918872628	0.508	0.53
12	KMPUR.IS	1.5490786879707954	0.726881493048814	2.131129630874735	0.529	0.528
13	SOKM.IS	1.3505768212308125	1.522540000677322	0.8870550662905347	0.478	0.526
14	TTRAK.IS	1.194565788089192	1.7842869268068549	0.6694919803212239	0.45	0.526
15	OTKAR.IS	0.8607010059685939	1.5796116847956545	0.5448813871492334	0.417	0.525
16	DOAS.IS	1.622840962573274	1.2056576139164834	1.346021410922462	0.526	0.523
17	GARAN.IS	0.9929938927315942	1.7056235798866164	0.5821881829269767	0.434	0.523
18	TURSG.IS	1.0118071683758696	3.03275404492108	0.3336265168190385	0.485	0.519
19	BRSAN.IS	3.410114191309624	5.322220170753569	0.6407315146503585	0.669	0.519
20	YKBNK.IS	0.8384133388031937	1.5229293730105549	0.5505267372614941	0.44	0.518
21	VESBE.IS	1.3005692429563975	1.0552943727940098	1.232423176400529	0.392	0.514
22	AGHOL.IS	1.4068627159259328	1.7014146619338368	0.8268782134079444	0.451	0.513
23	ISGYO.IS	0.8836996346634949	0.9844843898646878	0.8976268631186267	0.478	0.513
24	ISMEN.IS	1.2558541788020918	1.9692023454576262	0.6377476553889854	0.558	0.509
25	TUKAS.IS	0.7290822850380619	0.8127204596440716	0.8970886316278555	0.417	0.509
26	IZMDC.IS	0.9369930633852185	0.7070648117620596	1.325186952876583	0.571	0.505
27	ALARK.IS	1.3805098859139686	1.071801132082295	1.2880280161972903	0.508	0.505
28	BIMAS.IS	0.9219180199829096	1.7406728878671625	0.5296331242985757	0.448	0.505
29	GESAN.IS	2.3067506713380266	0.75994888122743	3.0354024176103565	0.504	0.505
30	EGEEN.IS	1.6421942150130804	2.0728456080756907	0.7922414523373972	0.605	0.504
31	DOHOL.IS	0.9694624048908166	0.9590369341797896	1.010870770811286	0.444	0.504
32	GLYHO.IS	1.1300653120279116	0.8096872094011268	1.395681318547378	0.509	0.504
33	KONYA.IS	1.794699160130383	1.9971727348059882	0.898619898535942	0.482	0.504
34	ECZYT.IS	2.240986862122136	1.1626374697829327	1.927502699995153	0.6	0.504
35	TTKOM.IS	1.4493501759043208	1.0974250567535875	1.3206825987660618	0.579	0.5
36	ECILC.IS	1.42631057547479	1.0954566007149174	1.302023808651069	0.556	0.5
37	GSDHO.IS	1.3258866888629381	0.9027500655971	1.4687195707772844	0.563	0.495
38	GWIND.IS	1.0959488949656366	0.9705665995842526	1.1291846385761597	0.44	0.495
39	KOZAA.IS	1.4989914782438873	0.7618404515202709	1.9675923945133313	0.496	0.495
40	VAKBN.IS	1.268262089307342	0.9044067816439317	1.4023137763319662	0.541	0.495
41	ASELS.IS	0.9952656271546826	1.3292474143322845	0.7487436999489145	0.392	0.495
42	ASUZU.IS	2.2842232730718237	0.8302416577059301	2.751275188218622	0.579	0.491
43	BERA.IS	1.490345341181292	0.9780325210017394	1.5238198210984042	0.541	0.491

BIST100'e bütünüyle bakıldığında ise görüldüğü gibi sadece 4 hissenin Markov olasılıklarının 0.56 dan büyük olduğu izlenmektedir. BIST100 ün bütününe yönelik önümüzdeki günlerde downtrend davranış olasılığı yüksektir.

Bu bilgi ve tahminler ışığında sizin de portföyleriniz incelenerek yapay zeka ile elde edilen 4 ayrı portföy önerimiz aşağıda sunulmaktadır:

1. Maximum Drawdown (MDD) Optimize Portföyü
2. Negatif-Sharp Optimize Portföyü
3. Ağırlık Sınırlamalı Sharpe Optimize Portföyü
4. Ağırlık Sınırlamalı Negatif Sharpe Optimize Portföyü

I. MDD Portföyü Performansı (26.12.2023 - 1.03.2023)

Portföyünüzden bağımsız olarak bir BIST30 uzayı seçilseydi nasıl olacağına dair bir portföy planladık. Buna göre:

Ağırlıklar

assets	End PF %	Rebalance Buy Price	Rebalance Shares	Final_Cost
TUPRS.IS	30.44	143.50	202.0	30440.0
BIMAS.IS	27.61	303.75	82.0	27610.0
THYAO.IS	14.25	227.70	66.0	14250.0
TCELL.IS	9.34	53.10	197.0	9340.0
FROTO.IS	7.91	736.00	13.0	7910.0
ASELS.IS	5.79	43.52	129.0	5790.0
GARAN.IS	4.23	56.20	69.0	4230.0
GUBRF.IS	0.00	172.60	1.0	0.0
AKBNK.IS	0.15	37.68	3.0	150.0
SAHOL.IS	0.06	61.70	1.0	60.0
YKBNK.IS	0.08	19.96	4.0	80.0
EREGL.IS	0.04	40.56	1.0	40.0
ISCTR.IS	0.04	8.92	5.0	40.0
ENKAI.IS	0.03	33.64	1.0	30.0
EKGYO.IS	0.03	6.84	5.0	30.0
SISE.IS	0.00	45.72	0.0	0.0

Eğer yeni portföy yapılacak ise alınması gereken ağırlıklar “End PF %” kolonundadır.

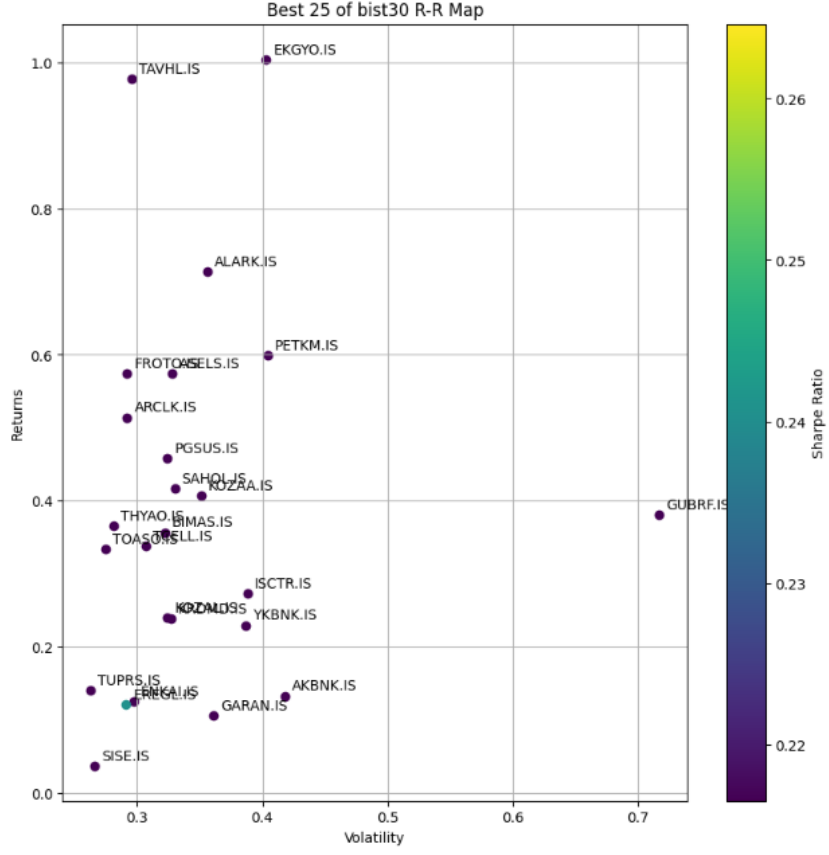
Portföy Performans Künyesi

Performing STEP-4: Showing Tearsheet of Portfolio...	
***** PORTFOLIO TEARSHEET *****	
Start date	2023-12-28
End date	2024-03-01
Total months	2
Backtest	
Annual return	199.5%
Cumulative returns	22.2%
Annual volatility	18.1%
Sharpe ratio	6.18
Calmar ratio	71.59
Stability	0.93
Max drawdown	-2.8%
Omega ratio	2.50
Sortino ratio	10.81
Skew	-0.61
Kurtosis	-0.03
Tail ratio	1.33
Daily value at risk	-1.8%
***** end of TEARSHEET *****	

Sharpe Oranı 6.18 Stability .93, MDD -2.8% ile bu çok düzgün bir uptrend portföyüdür, ancak 20.02.2024'te downtrend başladığı tahmin edildiğinden bugünlerde girilmesi halinde yüksek performans garanti edilemez.

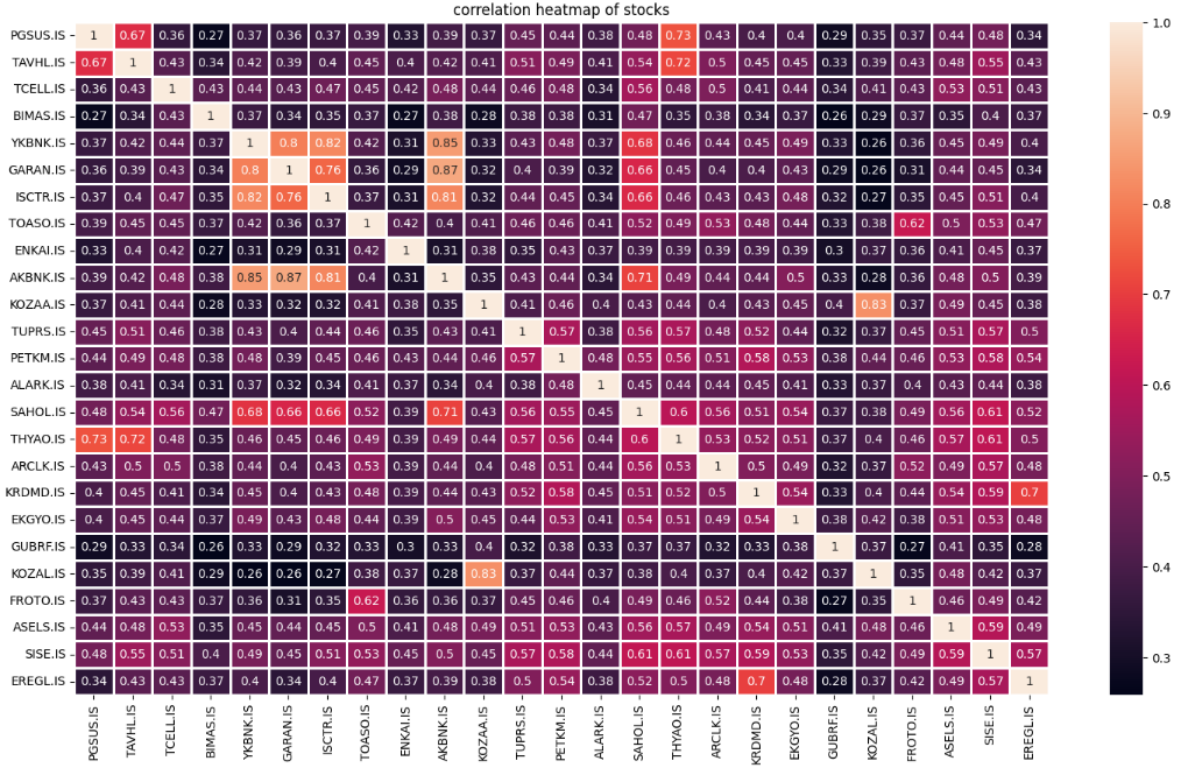
FONERA şirketine özel bilgidir. Üçüncü kişiler ile paylaşılmaması gerekmektedir.

Getiri-Risk Haritası



TAVHL ve EKGYO en iyi getirili ve riski makul seviyede hisseler olmuştur.

Korelasyon Haritası

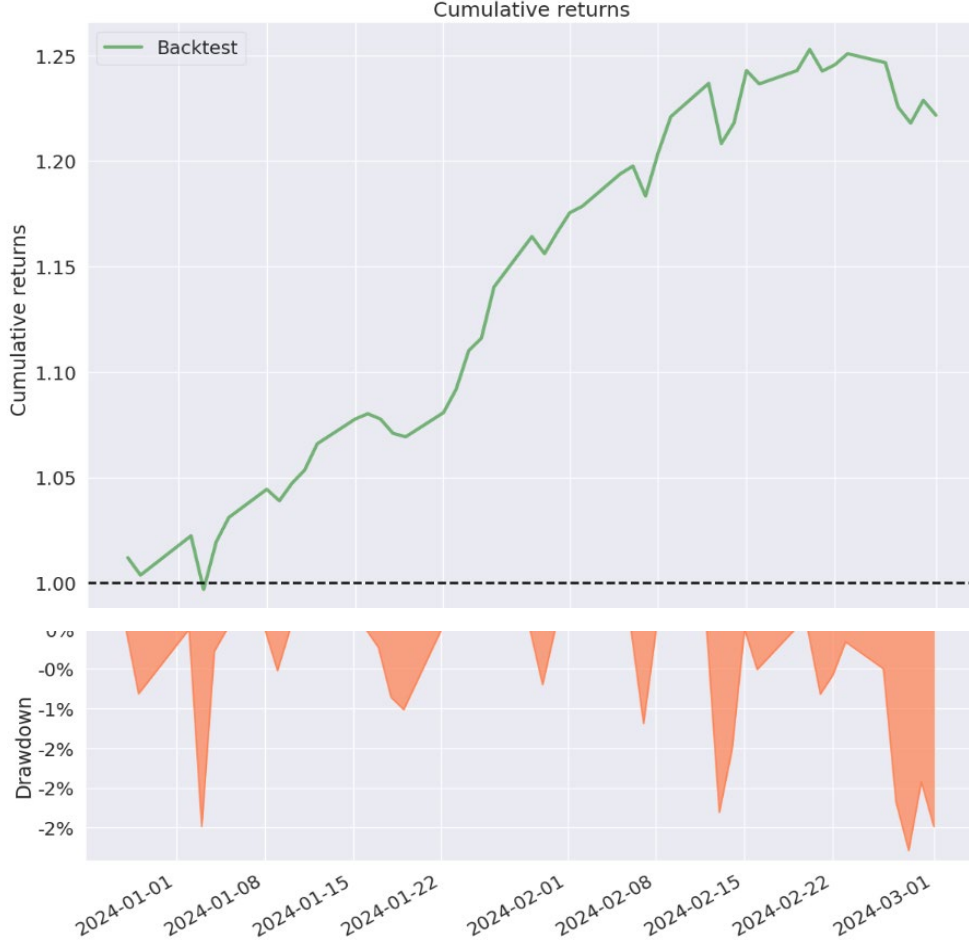


FONERA şirketine özel bilgidir. Üçüncü kişiler ile paylaşılmaması gerekmektedir.

26.12.2023 - 1.03.2023 Arası Tarihsel Seyir:

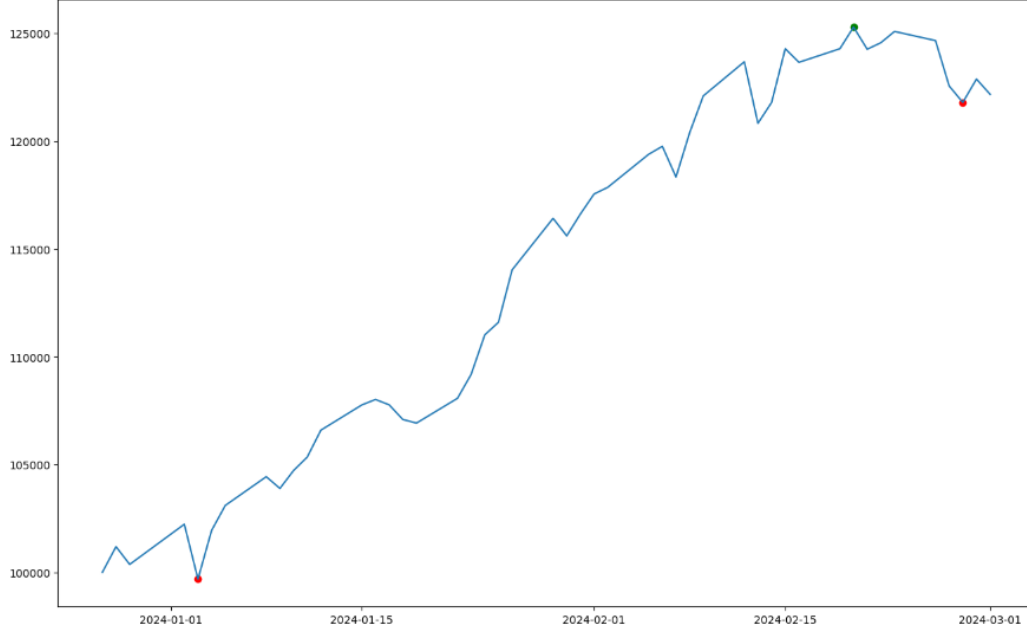
```
Date
2023-12-27 00:00:00+03:00      98596.93
2023-12-28 00:00:00+03:00      99787.35
2023-12-29 00:00:00+03:00      98963.95
2024-01-02 00:00:00+03:00     100826.72
2024-01-03 00:00:00+03:00      98284.34
2024-01-04 00:00:00+03:00     100541.67
2024-01-05 00:00:00+03:00     101698.88
2024-01-08 00:00:00+03:00     103032.32
2024-01-09 00:00:00+03:00     102487.57
2024-01-10 00:00:00+03:00     103318.84
2024-01-11 00:00:00+03:00     103942.00
2024-01-12 00:00:00+03:00     105191.21
2024-01-15 00:00:00+03:00     106361.62
2024-01-16 00:00:00+03:00     106614.41
2024-01-17 00:00:00+03:00     106365.31
2024-01-18 00:00:00+03:00     105686.61
2024-01-19 00:00:00+03:00     105519.50
2024-01-22 00:00:00+03:00     106667.99
2024-01-23 00:00:00+03:00     107777.32
2024-01-24 00:00:00+03:00     109610.92
2024-01-25 00:00:00+03:00     110194.41
2024-01-26 00:00:00+03:00     112623.10
2024-01-29 00:00:00+03:00     115015.81
2024-01-30 00:00:00+03:00     114204.09
2024-01-31 00:00:00+03:00     115216.18
2024-02-01 00:00:00+03:00     116143.61
2024-02-02 00:00:00+03:00     116453.19
2024-02-05 00:00:00+03:00     117987.38
2024-02-06 00:00:00+03:00     118356.50
2024-02-07 00:00:00+03:00     116931.99
2024-02-08 00:00:00+03:00     118991.25
2024-02-09 00:00:00+03:00     120696.78
2024-02-12 00:00:00+03:00     122276.56
2024-02-13 00:00:00+03:00     119424.47
2024-02-14 00:00:00+03:00     120392.56
2024-02-15 00:00:00+03:00     122884.51
2024-02-16 00:00:00+03:00     122252.77
2024-02-19 00:00:00+03:00     122883.57
2024-02-20 00:00:00+03:00     123885.68
2024-02-21 00:00:00+03:00     122860.27
2024-02-22 00:00:00+03:00     123162.58
2024-02-23 00:00:00+03:00     123684.71
2024-02-26 00:00:00+03:00     123260.23
2024-02-27 00:00:00+03:00     121155.25
2024-02-28 00:00:00+03:00     120393.73
2024-02-29 00:00:00+03:00     121476.66
2024-03-01 00:00:00+03:00     120767.42
Name: Portfolio, dtype: float64
```


26.12.2023 - 1.03.2023 Arası Tarihsel Grafik Seyir/Maksimum Çökme



26.12.2023 - 1.03.2023 Arası Uptrend-Downtrend Endikasyonu

```
Minimums: -----
Date
2024-01-03 00:00:00+03:00    99687.41
2024-02-28 00:00:00+03:00    121796.8
Name: min, dtype: object
Maximums: -----
Date
2024-02-20 00:00:00+03:00    125288.75
Name: max, dtype: object
```



Altaki kırmızı nokta uptrend işareti, üstteki yeşil nokta downtrend işaretidir. En sondaki kırmızı nokta ise henüz uptrend olarak değerlendirilmemelidir.

II. N-SHARPE Portföyü Performansı (26.12.2023 - 1.03.2023)

Portföyünüzde yer alan bazı hisselerle yapılan N-Sharpe özellikli bir optimize portföy aşağıdadır:

Ağırlıklar

assets	End PF %	Rebalance Buy Price	Rebalance Shares	Final_Cost
EKGYO.IS	47.67	6.84	6997.0	47670.0
AGHOLIS	25.82	187.00	142.0	25820.0
ISMEN.IS	12.76	29.06	439.0	12760.0
ENJSA.IS	13.74	43.90	291.0	13740.0

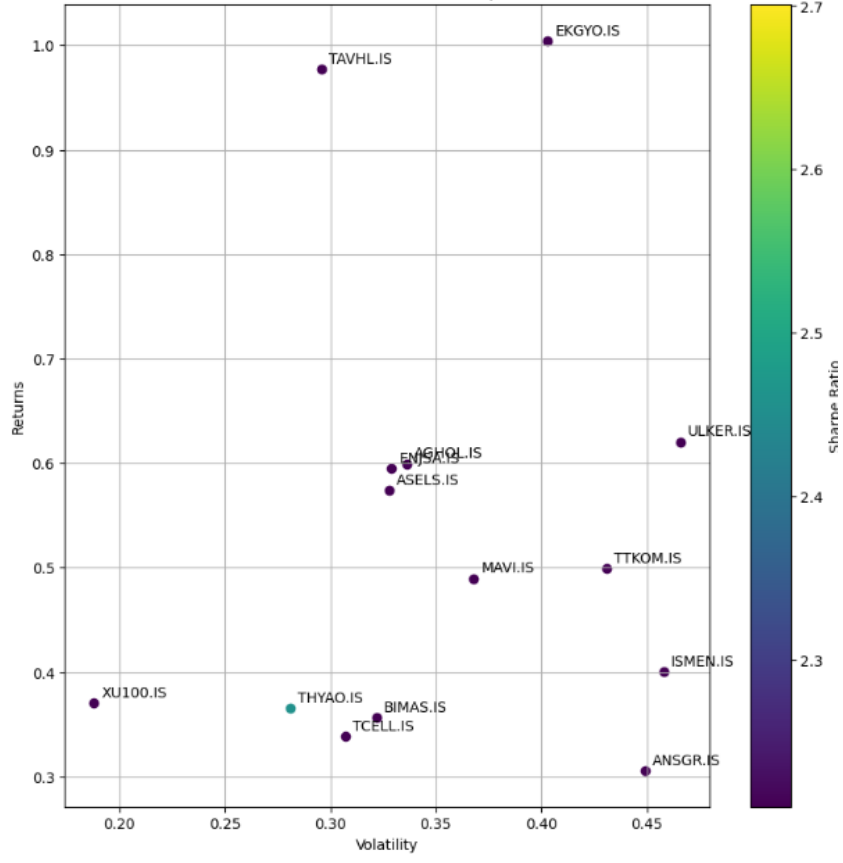
Eğer yeni portföy yapılacak ise alınması gereken ağırlıklar "End PF %" kolonundadır.

Portföy Performans Künyesi

***** PORTFOLIO TEARSHEET *****	
Start date	2023-12-28
End date	2024-03-01
Total months	2
Backtest	
Annual return	863.7%
Cumulative returns	51.2%
Annual volatility	27.1%
Sharpe ratio	8.54
Calmar ratio	177.45
Stability	0.95
Max drawdown	-4.9%
Omega ratio	3.75
Sortino ratio	17.77
Skew	-0.14
Kurtosis	0.52
Tail ratio	1.76
Daily value at risk	-2.5%
***** end of TEARSHEET *****	

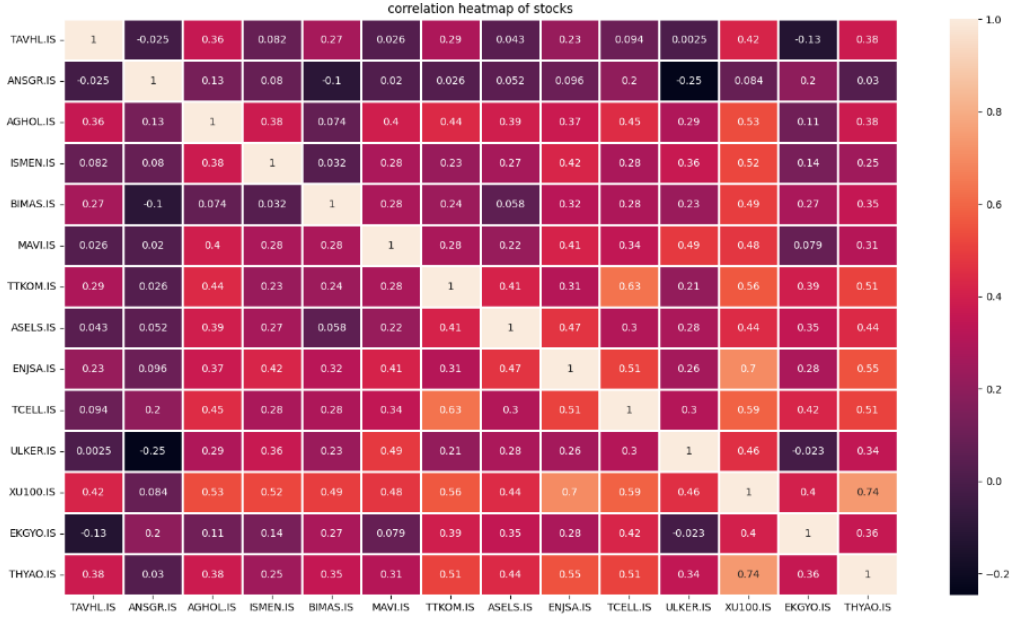
Sharpe Oranı 8.54 Stability 0.95, MDD -4.9% ile bu çok düzgün bir uptrend portföyüdür, ancak 20.02.2024'te downtrend başladığı tahmin edildiğinden bugünlerde girilmesi halinde yüksek performans garanti edilemez.

Getiri-Risk Haritası



TAVHL ve EKGYO burada da en iyi getirili ve riski makul seviyede hisseler olmuştur. Ancak bu pozitif ayrışma çok daha fazla risk taşımaktadır. Downtrend de bunları aşağıya olma riskleri artmıştır.

Korelasyon Haritası

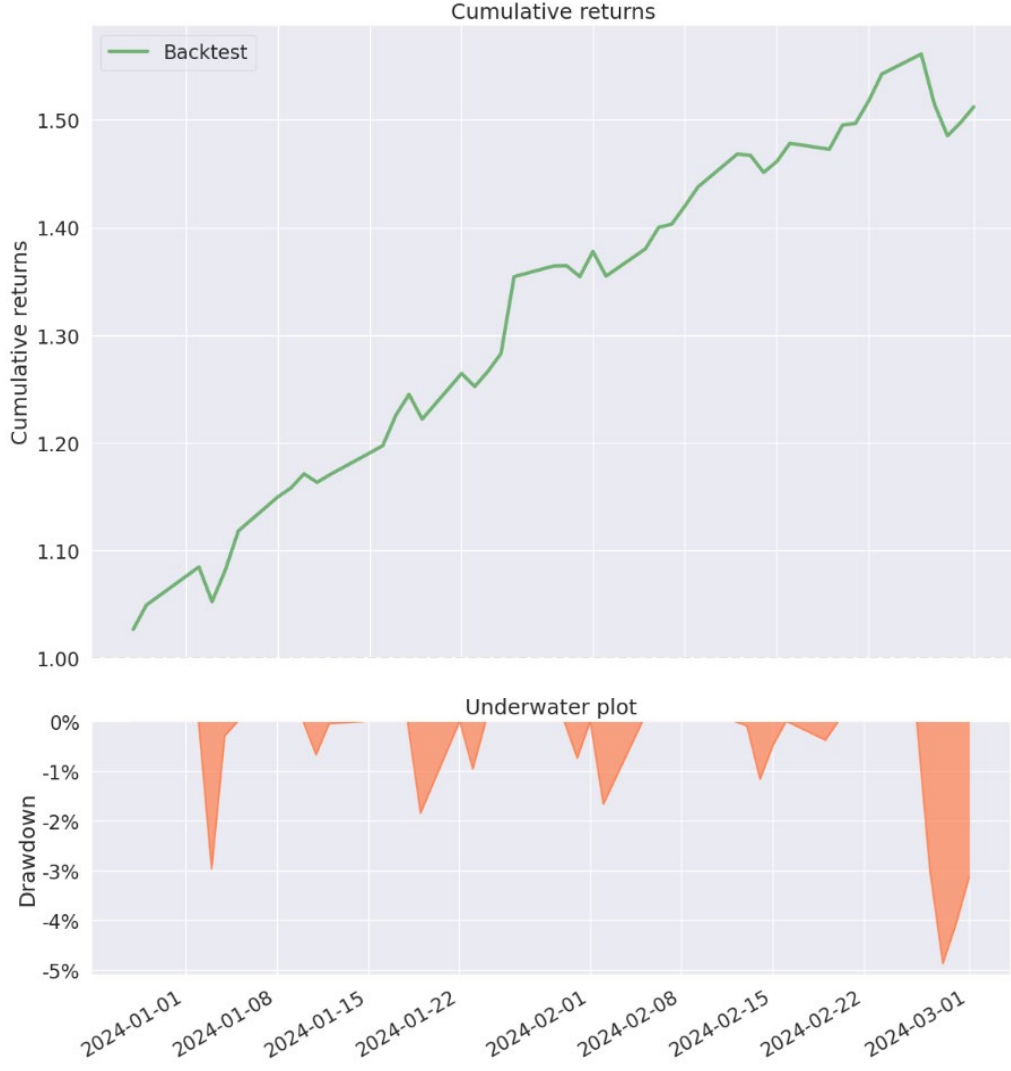


FONERA şirketine özel bilgidir. Üçüncü kişiler ile paylaşılmaması gerekmektedir.

26.12.2023 - 1.03.2023 Arası Tarihsel Seyir:

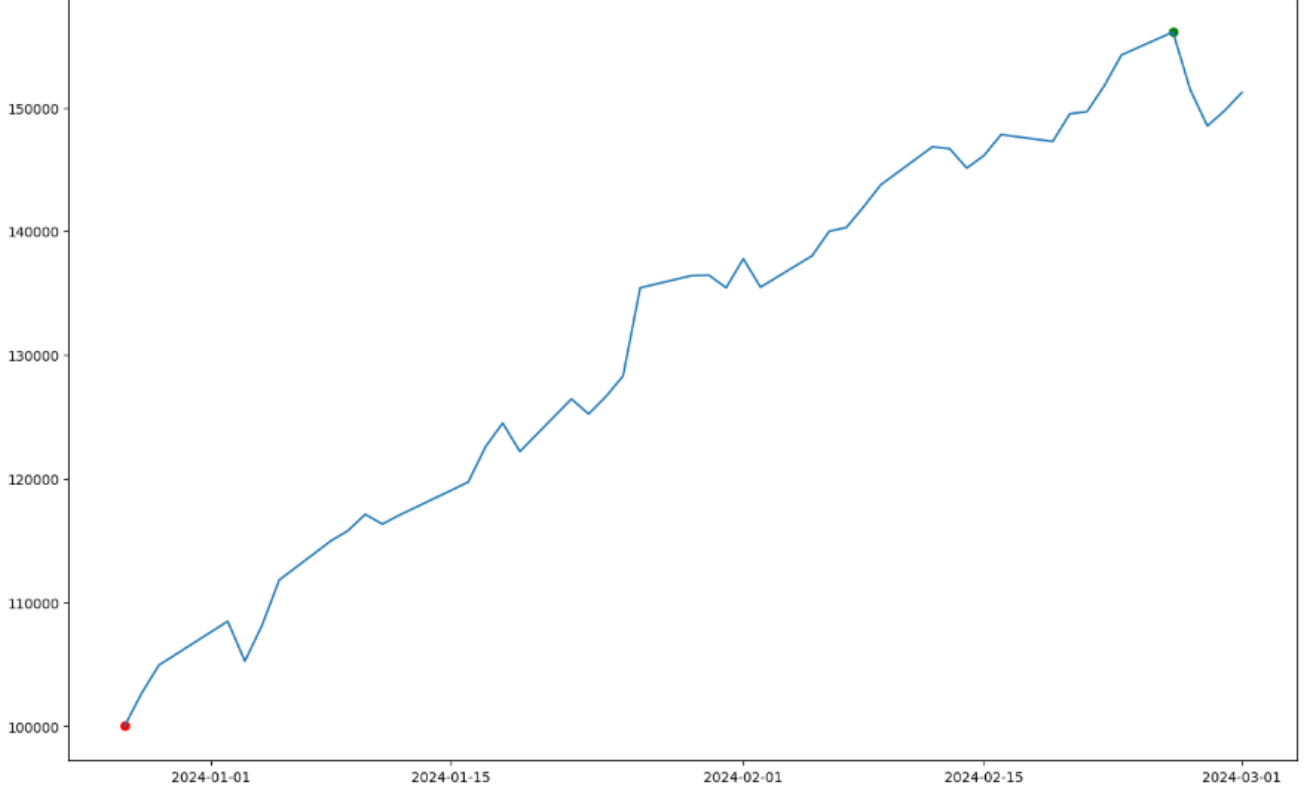
Date	
2023-12-27 00:00:00+03:00	99816.96
2023-12-28 00:00:00+03:00	102478.06
2023-12-29 00:00:00+03:00	104737.56
2024-01-02 00:00:00+03:00	108277.49
2024-01-03 00:00:00+03:00	105056.40
2024-01-04 00:00:00+03:00	107955.26
2024-01-05 00:00:00+03:00	111620.12
2024-01-08 00:00:00+03:00	114779.66
2024-01-09 00:00:00+03:00	115609.43
2024-01-10 00:00:00+03:00	116928.55
2024-01-11 00:00:00+03:00	116140.39
2024-01-12 00:00:00+03:00	116873.05
2024-01-15 00:00:00+03:00	118869.93
2024-01-16 00:00:00+03:00	119549.77
2024-01-17 00:00:00+03:00	122391.22
2024-01-18 00:00:00+03:00	124309.02
2024-01-19 00:00:00+03:00	122009.94
2024-01-22 00:00:00+03:00	126255.53
2024-01-23 00:00:00+03:00	125043.84
2024-01-24 00:00:00+03:00	126444.47
2024-01-25 00:00:00+03:00	128107.99
2024-01-26 00:00:00+03:00	135251.61
2024-01-29 00:00:00+03:00	136242.80
2024-01-30 00:00:00+03:00	136270.65
2024-01-31 00:00:00+03:00	135259.85
2024-02-01 00:00:00+03:00	137601.56
2024-02-02 00:00:00+03:00	135304.67
2024-02-05 00:00:00+03:00	137841.33
2024-02-06 00:00:00+03:00	139823.95
2024-02-07 00:00:00+03:00	140135.40
2024-02-08 00:00:00+03:00	141804.58
2024-02-09 00:00:00+03:00	143587.41
2024-02-12 00:00:00+03:00	146653.62
2024-02-13 00:00:00+03:00	146515.49
2024-02-14 00:00:00+03:00	144941.00
2024-02-15 00:00:00+03:00	145950.77
2024-02-16 00:00:00+03:00	147648.92
2024-02-19 00:00:00+03:00	147088.08
2024-02-20 00:00:00+03:00	149328.81
2024-02-21 00:00:00+03:00	149506.67
2024-02-22 00:00:00+03:00	151590.20
2024-02-23 00:00:00+03:00	154086.07
2024-02-26 00:00:00+03:00	155941.17
2024-02-27 00:00:00+03:00	151288.50
2024-02-28 00:00:00+03:00	148342.35
2024-02-29 00:00:00+03:00	149574.50
2024-03-01 00:00:00+03:00	151035.86

26.12.2023 - 1.03.2023 Arası Tarihsel Grafik Seyir:



26.12.2023 - 1.03.2023 Arası Uptrend-Downtrend Endikasyonu

Minimums: -----
Date
2023-12-27 00:00:00+03:00 100000.0
Name: min, dtype: object
Maximums: -----
Date
2024-02-26 00:00:00+03:00 156109.82
Name: max, dtype: object



Altteki kırmızı nokta uptrend işareti, üstteki yeşil nokta downtrend işaretidir.

III. Ağırlık sınırlamalı SHARPE Portföyü Performansı (26.12.2023 - 1.03.2023)

Portföyünüzde yer alan hisselerle yapılan Ağırlık sınırlama özellikli bir optimize portföy aşağıdadır:

Ağırlıklar

assets	End PF %	Rebalance Buy Price	Rebalance Shares	Final_Cost
TAVHL.IS	8.49	102.50	87.0	8490.0
AGHOL.IS	7.43	187.00	48.0	7430.0
ISMEN.IS	7.75	29.06	309.0	7750.0
MAVL.IS	9.30	106.40	84.0	9300.0
TTKOM.IS	9.65	24.42	368.0	9650.0
ASELS.IS	10.72	43.52	206.0	10720.0
ENJSA.IS	8.37	43.90	205.0	8370.0
TCELL.IS	9.34	53.10	169.0	9340.0
EKGYO.IS	7.73	6.84	1315.0	7730.0
THYAO.IS	9.82	227.70	39.0	9820.0
ULKER.IS	5.86	74.85	75.0	5860.0
BIMAS.IS	5.52	303.75	14.0	5520.0

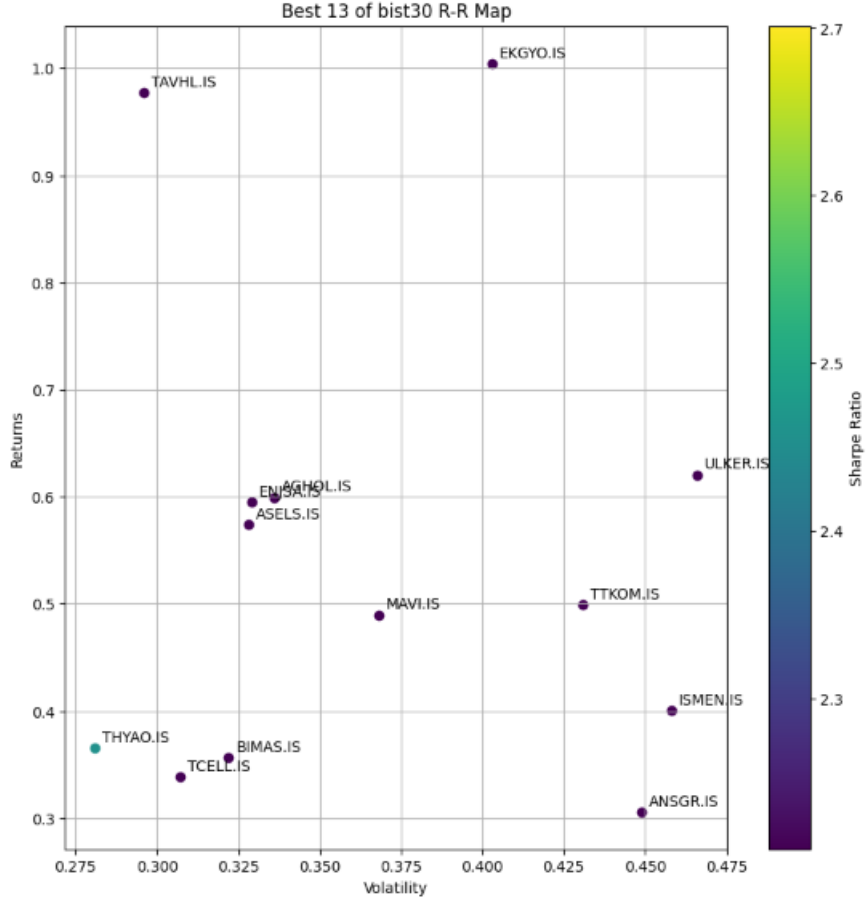
Eğer yeni portföy yapılacak ise alınması gereken ağırlıklar “End PF %” kolonundadır.

Portföy Performans Künyesi

Performing STEP-4: Showing Tearsheet of Portfolio...	
***** PORTFOLIO TEARSHEET *****	
Start date	2023-12-28
End date	2024-03-01
Total months	2
Backtest	
Annual return	491.5%
Cumulative returns	38.3%
Annual volatility	21.3%
Sharpe ratio	8.48
Calmar ratio	112.28
Stability	0.94
Max drawdown	-4.4%
Omega ratio	3.73
Sortino ratio	17.20
Skew	-0.38
Kurtosis	0.11
Tail ratio	1.32
Daily value at risk	-2.0%
***** end of TEARSHEET *****	

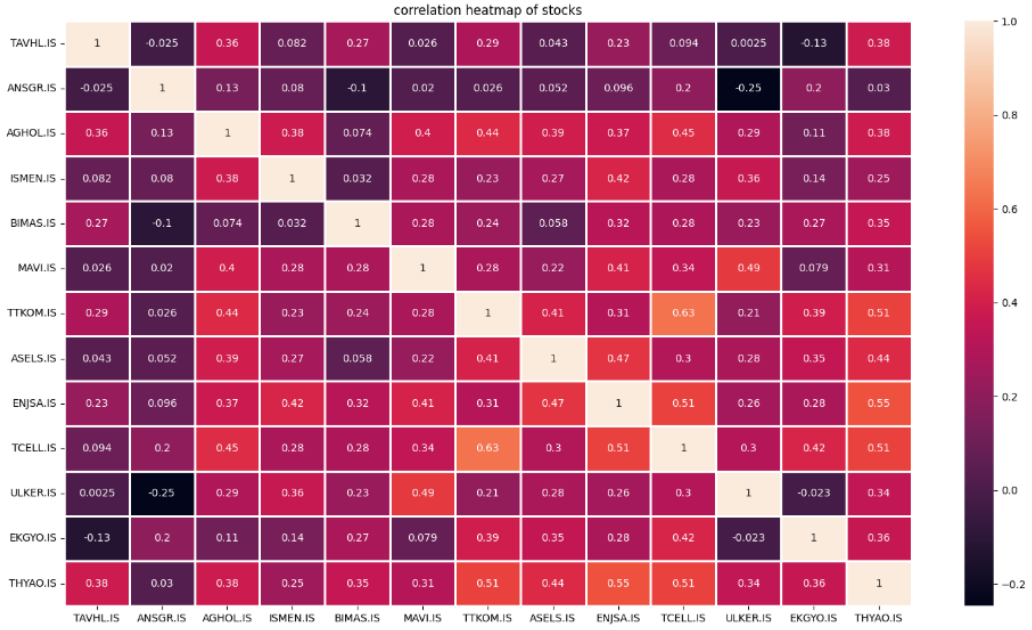
Sharpe Oranı 8.48 Stability 0.94, MDD -4.4% ile bu çok düzgün bir uptrend portföyüdür, ancak 20.02.2024'te downtrend başladığı tahmin edildiğinden bugünlerde girilmesi halinde yüksek performans garanti edilemez.

Getiri-Risk Haritası



TAVHL ve EKGYO burada da en iyi getirili ve riski makul seviyede hisseler olmuştur. Ancak bu pozitif ayrışma çok daha fazla risk taşımaktadır. Downtrend de bunları alaşağı olma riskleri artmıştır.

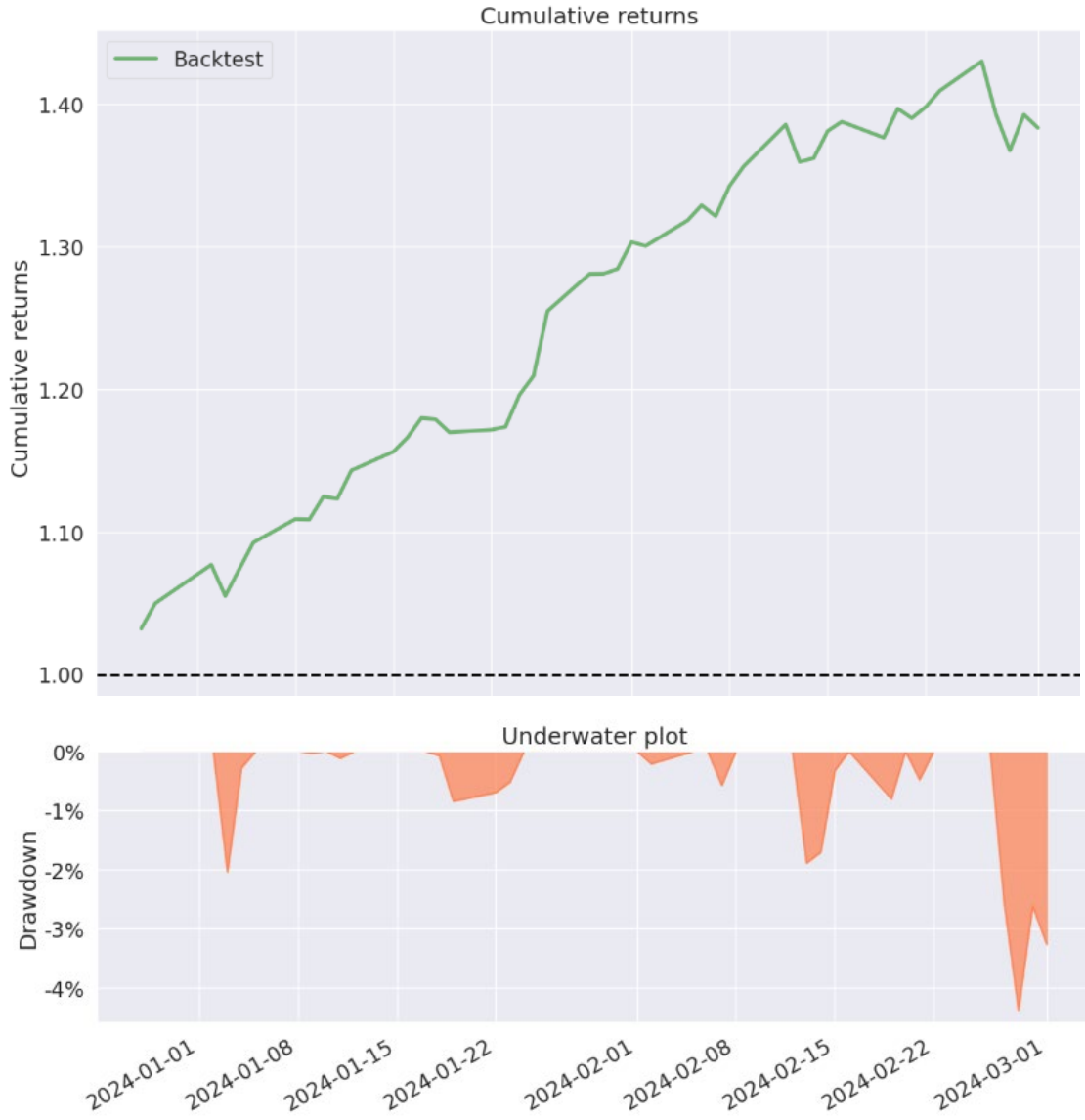
Korelasyon Haritası



26.12.2023 - 1.03.2023 Arası Tarihsel Seyir:

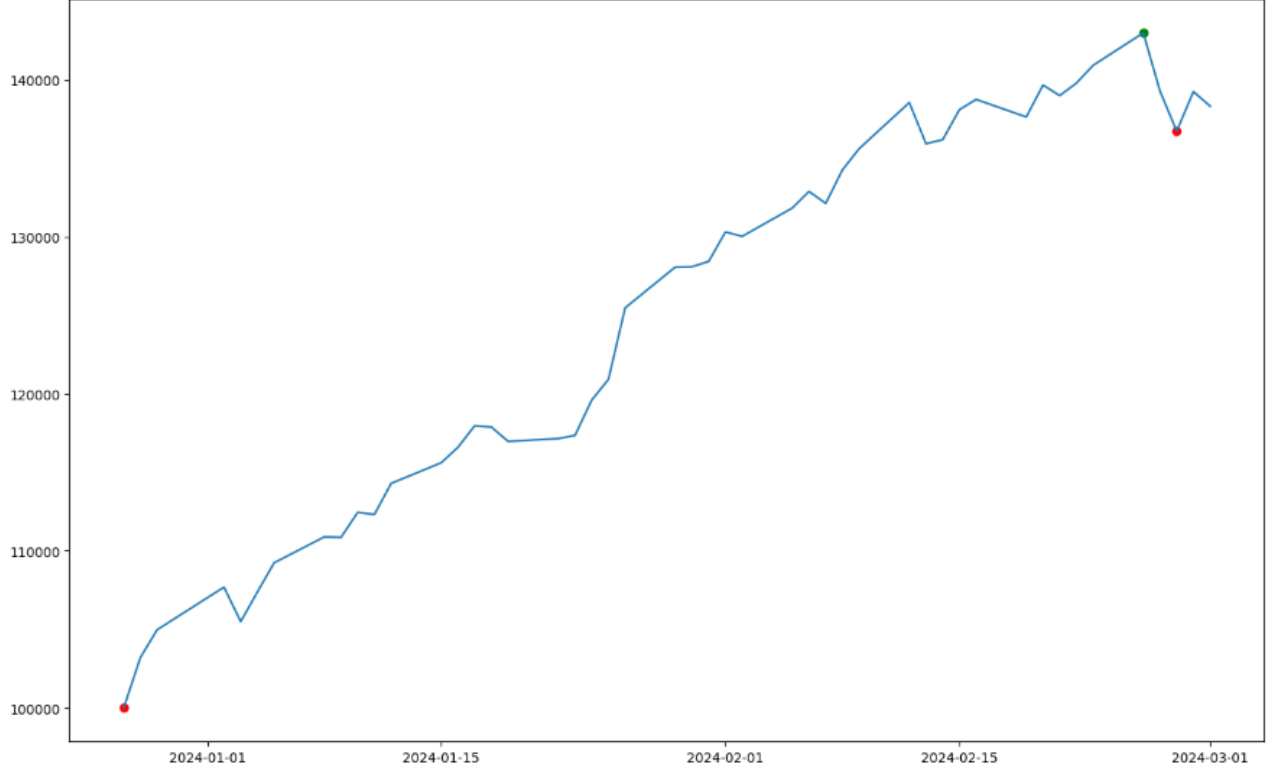
Date	
2023-12-27 00:00:00+03:00	100000.0
2023-12-28 00:00:00+03:00	103209.08
2023-12-29 00:00:00+03:00	104975.36
2024-01-02 00:00:00+03:00	107688.89
2024-01-03 00:00:00+03:00	105492.3
2024-01-04 00:00:00+03:00	107384.2
2024-01-05 00:00:00+03:00	109240.51
2024-01-08 00:00:00+03:00	110889.3
2024-01-09 00:00:00+03:00	110859.91
2024-01-10 00:00:00+03:00	112452.47
2024-01-11 00:00:00+03:00	112319.16
2024-01-12 00:00:00+03:00	114296.83
2024-01-15 00:00:00+03:00	115613.56
2024-01-16 00:00:00+03:00	116601.12
2024-01-17 00:00:00+03:00	117971.5
2024-01-18 00:00:00+03:00	117886.23
2024-01-19 00:00:00+03:00	116972.39
2024-01-22 00:00:00+03:00	117151.77
2024-01-23 00:00:00+03:00	117355.44
2024-01-24 00:00:00+03:00	119605.11
2024-01-25 00:00:00+03:00	120922.62
2024-01-26 00:00:00+03:00	125477.18
2024-01-29 00:00:00+03:00	128079.46
2024-01-30 00:00:00+03:00	128098.61
2024-01-31 00:00:00+03:00	128440.45
2024-02-01 00:00:00+03:00	130314.13
2024-02-02 00:00:00+03:00	130036.04
2024-02-05 00:00:00+03:00	131838.22
2024-02-06 00:00:00+03:00	132898.46
2024-02-07 00:00:00+03:00	132134.1
2024-02-08 00:00:00+03:00	134268.03
2024-02-09 00:00:00+03:00	135620.67
2024-02-12 00:00:00+03:00	138556.12
2024-02-13 00:00:00+03:00	135939.21
2024-02-14 00:00:00+03:00	136191.76
2024-02-15 00:00:00+03:00	138105.24
2024-02-16 00:00:00+03:00	138755.73
2024-02-19 00:00:00+03:00	137640.79
2024-02-20 00:00:00+03:00	139672.61
2024-02-21 00:00:00+03:00	139001.7
2024-02-22 00:00:00+03:00	139798.4
2024-02-23 00:00:00+03:00	140931.49
2024-02-26 00:00:00+03:00	142995.24
2024-02-27 00:00:00+03:00	139285.21
2024-02-28 00:00:00+03:00	136736.04
2024-02-29 00:00:00+03:00	139254.97
2024-03-01 00:00:00+03:00	138327.54

26.12.2023 - 1.03.2023 Arası Tarihsel Grafik Seyir:



26.12.2023 - 1.03.2023 Arası Uptrend-Downtrend Endikasyonu

```
Minimums: -----  
Date  
2023-12-27 00:00:00+03:00    100000.0  
2024-02-28 00:00:00+03:00    136736.04  
Name: min, dtype: object  
Maximums: -----  
Date  
2024-02-26 00:00:00+03:00    142995.24  
Name: max, dtype: object
```



Altındaki kırmızı nokta uptrend işareti, üstteki yeşil nokta downtrend işaretidir.

IV. Ağırlık sınırlamalı N-Sharpe BIST100 Portföyü Performansı (26.12.2023 - 1.03.2023)

Portföyünüz dışında bağımsız olarak BIST100'den tümüyle yapay zekanın seçtiği hisseler ve ağırlıkları aşağıdadır:

Ağırlıklar

assets	End PF %	Rebalance	Buy Price	Rebalance	Shares	Final_Cost
AHGAZ.IS	9.15		9.62		935.0	9150.0
TUKAS.IS	8.33		6.30		1428.0	8330.0
GWIND.IS	8.76		20.78		433.0	8760.0
IPEKE.IS	8.11		29.82		301.0	8110.0
PENTA.IS	10.01		17.11		526.0	10010.0
TOASO.IS	9.98		211.50		42.0	9980.0
KARSN.IS	9.59		8.13		1107.0	9590.0
KOZAL.IS	8.18		18.99		473.0	8180.0
GUBRF.IS	6.79		172.60		52.0	6790.0
HALKB.IS	8.00		11.49		579.0	8000.0
TTRAK.IS	4.33		688.00		6.0	4330.0
AKFGY.IS	3.26		1.75		1611.0	3260.0
KOZAA.IS	1.74		39.48		49.0	1740.0
IZMDC.IS	1.96		5.52		318.0	1960.0
QUAGR.IS	1.30		5.31		201.0	1300.0
KZBGY.IS	0.51		17.13		26.0	510.0

Eğer yeni portföy yapılacak ise alınması gereken ağırlıklar "End PF %" kolonundadır.

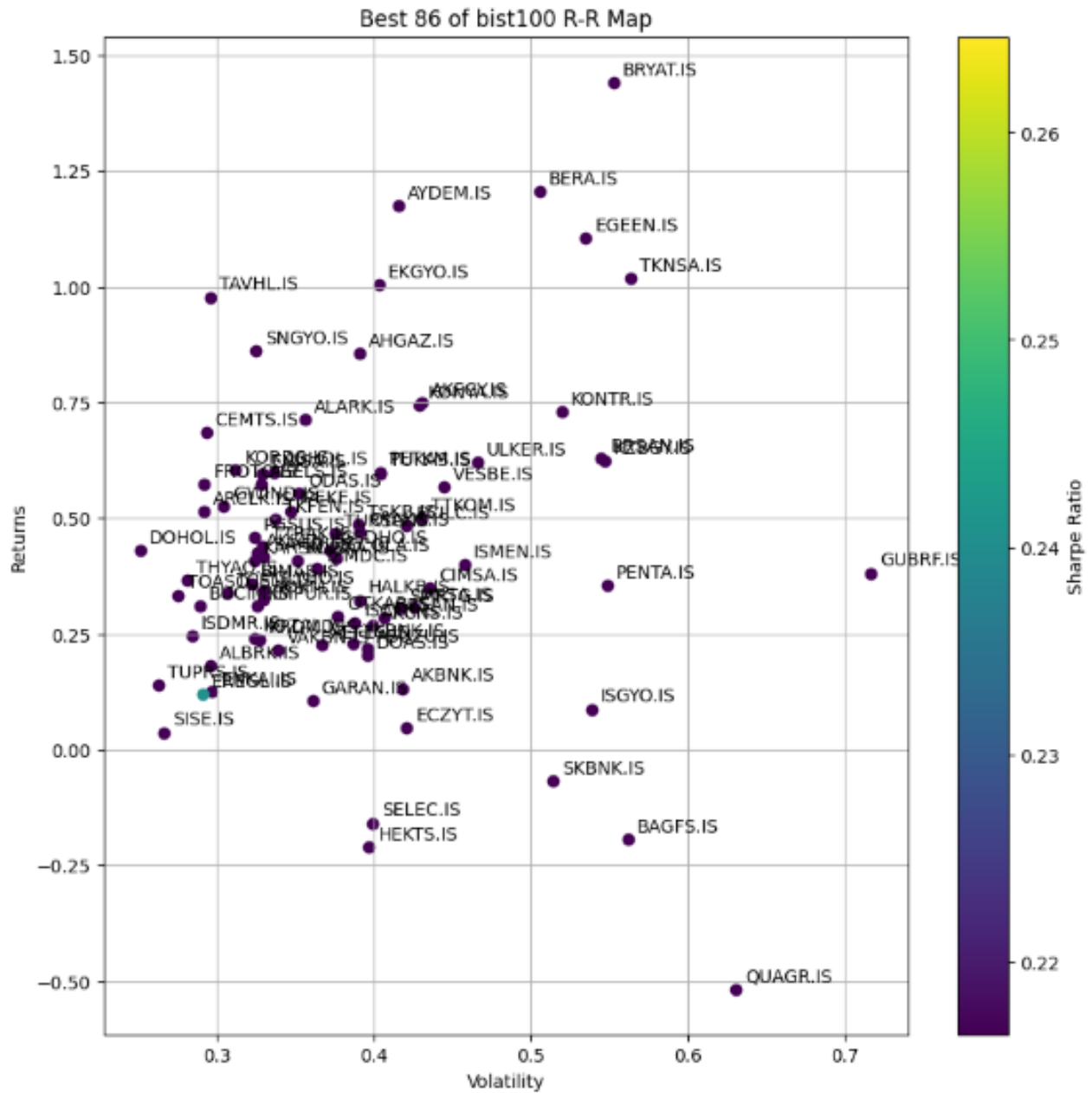
Portföy Performans Künyesi

***** PORTFOLIO TEARSHEET *****	
Start date	2023-12-28
End date	2024-03-01
Total months	2
Backtest	
Annual return	329.7%
Cumulative returns	30.5%
Annual volatility	23.4%
Sharpe ratio	6.37
Calmar ratio	75.06
Stability	0.93
Max drawdown	-4.4%
Omega ratio	2.67
Sortino ratio	11.33
Skew	-0.51
Kurtosis	-0.04
Tail ratio	1.53
Daily value at risk	-2.4%
***** end of TEARSHEET *****	

Sharpe Oranı 6.37 Stability 0.93, MDD -4.4% ile bu çok düzgün bir uptrend portföyüdür, ancak 20.02.2024'te downtrend başladığı tahmin edildiğinden bugünlerde girilmesi halinde yüksek performans garanti edilemez.

FONERA şirketine özel bilgidir. Üçüncü kişiler ile paylaşılmaması gerekmektedir.

Getiri-Risk Haritası



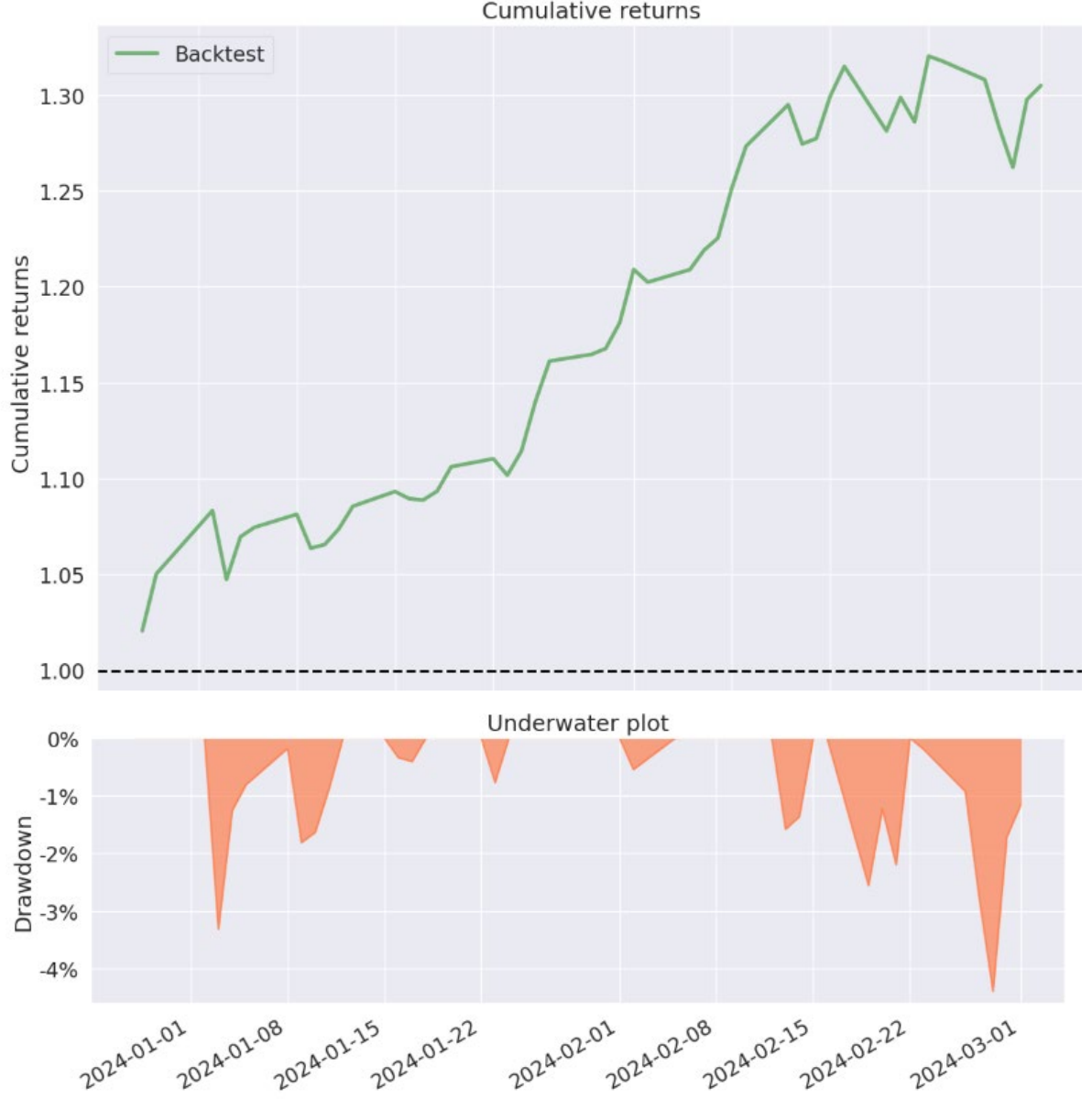
FONERA şirketine özel bilgidir. Üçüncü kişiler ile paylaşılmaması gerekmektedir.

26.12.2023 - 1.03.2023 Arası Tarihsel Seyir:

```
Performing STEP-3:
Construct Time series...
=====
Residue cash: 605.4600000000064

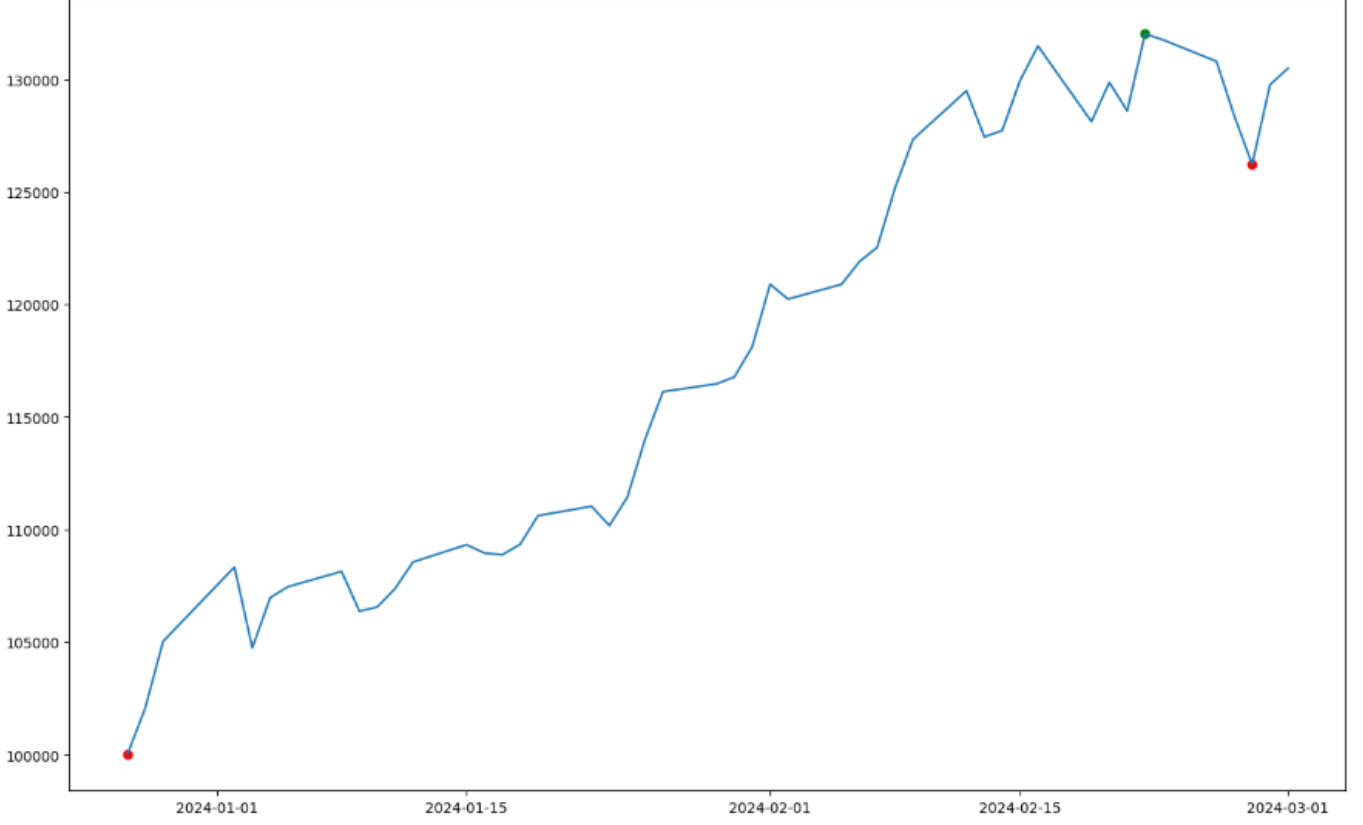
Date
2023-12-27 00:00:00+03:00      100000.0
2023-12-28 00:00:00+03:00      102062.66
2023-12-29 00:00:00+03:00      105027.98
2024-01-02 00:00:00+03:00       108331.9
2024-01-03 00:00:00+03:00      104740.79
2024-01-04 00:00:00+03:00      106970.81
2024-01-05 00:00:00+03:00      107458.77
2024-01-08 00:00:00+03:00      108136.08
2024-01-09 00:00:00+03:00      106367.39
2024-01-10 00:00:00+03:00      106561.27
2024-01-11 00:00:00+03:00      107379.54
2024-01-12 00:00:00+03:00      108557.66
2024-01-15 00:00:00+03:00      109324.41
2024-01-16 00:00:00+03:00      108954.12
2024-01-17 00:00:00+03:00      108878.32
2024-01-18 00:00:00+03:00      109343.05
2024-01-19 00:00:00+03:00      110615.88
2024-01-22 00:00:00+03:00      111031.65
2024-01-23 00:00:00+03:00      110174.91
2024-01-24 00:00:00+03:00      111428.08
2024-01-25 00:00:00+03:00      114018.94
2024-01-26 00:00:00+03:00      116123.55
2024-01-29 00:00:00+03:00      116473.66
2024-01-30 00:00:00+03:00      116778.74
2024-01-31 00:00:00+03:00      118122.31
2024-02-01 00:00:00+03:00      120899.33
2024-02-02 00:00:00+03:00       120239.0
2024-02-05 00:00:00+03:00      120893.37
2024-02-06 00:00:00+03:00      121899.97
2024-02-07 00:00:00+03:00      122544.15
2024-02-08 00:00:00+03:00      125185.75
2024-02-09 00:00:00+03:00      127331.48
2024-02-12 00:00:00+03:00      129494.78
2024-02-13 00:00:00+03:00      127446.76
2024-02-14 00:00:00+03:00      127729.87
2024-02-15 00:00:00+03:00      129950.67
2024-02-16 00:00:00+03:00      131487.74
2024-02-19 00:00:00+03:00      128124.29
2024-02-20 00:00:00+03:00      129870.24
2024-02-21 00:00:00+03:00      128595.69
2024-02-22 00:00:00+03:00      132024.68
2024-02-23 00:00:00+03:00      131759.59
2024-02-26 00:00:00+03:00      130800.83
2024-02-27 00:00:00+03:00      128376.66
2024-02-28 00:00:00+03:00      126224.95
2024-02-29 00:00:00+03:00      129764.23
2024-03-01 00:00:00+03:00      130491.11
```

26.12.2023 - 1.03.2023 Arası Tarihsel Grafik Seyir:



26.12.2023 - 1.03.2023 Arası Uptrend-Downtrend Endikasyonu

Minimums: -----
Date
2023-12-27 00:00:00+03:00 100000.0
2024-02-28 00:00:00+03:00 126224.95
Name: min, dtype: object
Maximums: -----
Date
2024-02-22 00:00:00+03:00 132024.68
Name: max, dtype: object



Görüş ve Değerlendirme

MHI endeksinin belirttiği gibi BIST30 yükseliş trendi 26.12.2023 te başlamış olup trendin 20 şubatta tamamlandığı veya önümüzdeki en fazla 2 hafta daha devam edebileceği düşünülmektedir.


31 Mart 2024'deki Belediye Seçimleri'nden önce ay boyunca kararsız bir piyasa beklentisi hakimdir.

Mart ayı içerisinde downtrend'e girilmesi ve bu rejimin en az Haziran sonuna dek sürmesi beklenmektedir.

Risklerin azaltılması gereken bu dönemde, en ağırlıkları en çok dağıtılmış olan veya ağırlık sınırlamalı portföylerle devam edilmesi güvenli olacak, alternatif yatırım araçların ağırlıklarının arttırılması da ayrıca uygun olacaktır.

Saygılarımızla,

Alper Ülkü



*“Birikimlerin sonucunda oluřan yatırıma
yönlenecek nakdin yönetiminde matematiksel
yöntemler kullanılırsa uzun vade istikrar
sağlanır, krizlere dayanım artar.”*



Özel Bilgi. Üçüncü kişiler ile paylaşılmaması gerekmektedir.