

RiskProfile RL – Profil Raporu (Agresif)

Oluşturulma zamanı: 2025-12-11 20:51

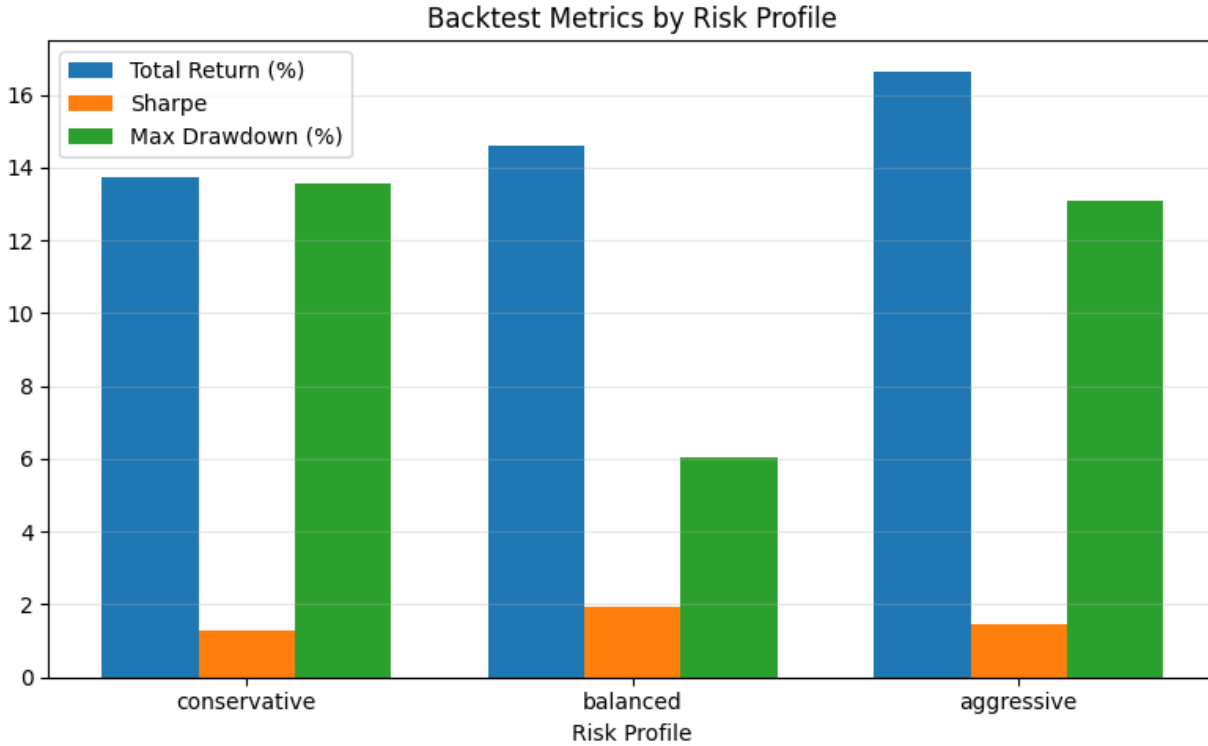
Bu rapor, seçili risk profili için RL tabanlı portföy ajanının performans özetini, önerilerini ve açıklanabilirlik (explainability) çıktılarının kısa bir özetini içerir.

1. Özet Metrikler

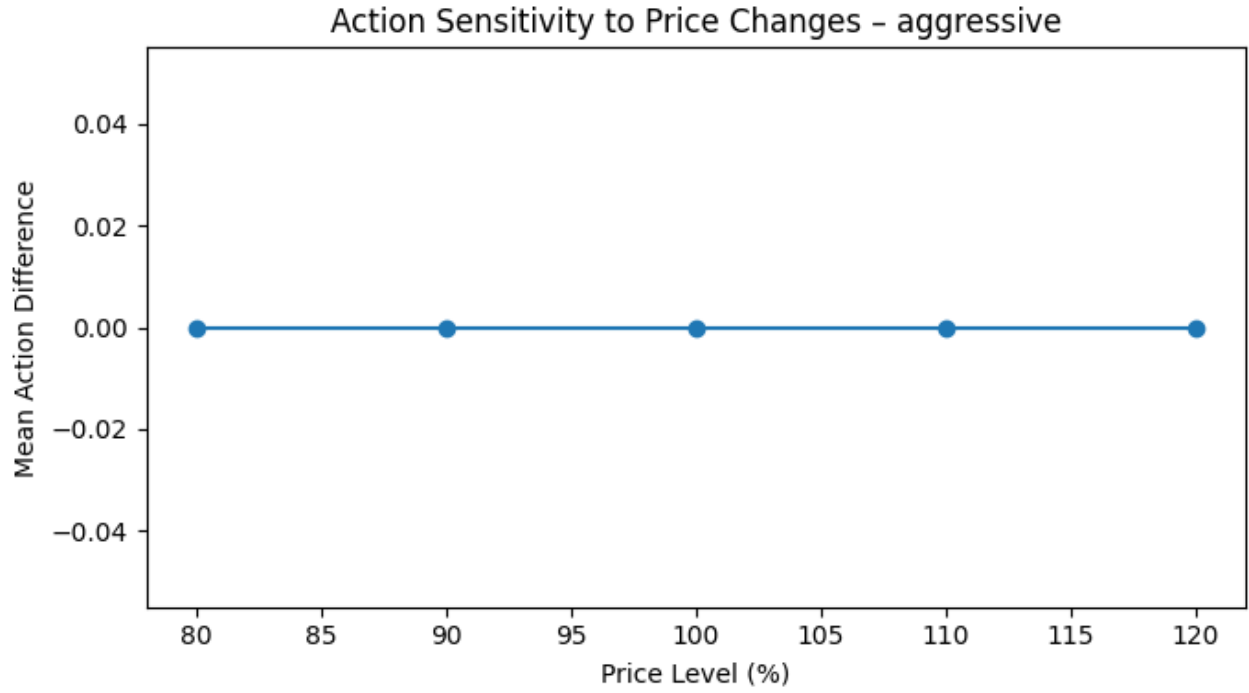
- Toplam Getiri (%): 16.65
- Sharpe Oranı: 1.46
- Volatilité (%): 11.09
- Maksimum Gerileme (%): 13.08

2. Görsel Özetler (Backtest & Sensitivity)

Aşağıdaki grafikler, backtest sonuçlarını ve ajan aksiyonlarının fiyat değişimlerine duyarlılığını (sensitivity) özetler. Grafikleri üretebilmek için daha önce `analysis.py` ve `model_analysis.py` komutlarının çalıştırılmış olması gerekir.



Backtest Metrics by Risk Profile



Action Sensitivity to Price Changes

3. Ajan Önerileri ve Açıklanabilirlik

- Öneri: UNH – BUY x 5

Neden: RL ajanı bu hissede pozisyonu artırma eğiliminde.

Risk Notu: Bu işlem portföy riskini bir miktar artırabilir.

Sinyal şiddeti yorumu: Model sinyali ****zayıf****; bu nedenle işlem önerisi daha sınırlı ve düşük etkili.

Risk profiliyle uyum: Agresif profilde bu alım, ****yüksek getiri potansiyeli gördüğü trendde daha cesur pozisyon almak**** anlamına geliyor.

Bu kararı verirken en hassas olduğu faktörler: momentum, trend gücü, breakout / breakdown sinyalleri, hızlı yükseliş potansiyeli, risk alımı sonrası ödül beklentisi.

- Öneri: DIS – BUY x 5

Neden: RL ajanı bu hissede pozisyonu artırma eğiliminde.

Risk Notu: Bu işlem portföy riskini bir miktar artırabilir.

Sinyal şiddeti yorumu: Model sinyali ****zayıf****; bu nedenle işlem önerisi daha sınırlı ve düşük etkili.

Risk profiliyle uyum: Agresif profilde bu alım, ****yüksek getiri potansiyeli gördüğü trendde daha cesur pozisyon almak**** anlamına geliyor.

Bu kararı verirken en hassas olduğu faktörler: momentum, trend gücü, breakout / breakdown sinyalleri, hızlı yükseliş potansiyeli, risk alımı sonrası ödül beklentisi.

- Öneri: NKE – SELL x 6

Neden: RL ajanı bu hissede pozisyonu azaltma eğiliminde.

Risk Notu: Bu işlem portföy riskini azaltma potansiyeline sahiptir.

Sinyal şiddeti yorumu: Model sinyali ****zayıf****; bu nedenle işlem önerisi daha sınırlı ve düşük etkili.

Risk profiliyle uyum: Agresif profilde bile, model bu hissede ****risk/ödül oranını beğenmediği için pozisyon küçültmeyi**** tercih ediyor.

Bu kararı verirken en hassas olduğu faktörler: momentum, trend gücü, breakout / breakdown sinyalleri, momentum kırılması, aşağı yönlü hızlanan hareket.

- Öneri: VZ – SELL x 6

Neden: RL ajanı bu hissede pozisyonu azaltma eğiliminde.

Risk Notu: Bu işlem portföy riskini azaltma potansiyeline sahiptir.

Sinyal şiddeti yorumu: Model sinyali ****zayıf****; bu nedenle işlem önerisi daha sınırlı ve düşük etkili.

Risk profiliyle uyum: Agresif profile bile, model bu hissede ****risk/ödül oranını beğenmediği için pozisyon küçültmeyi**** tercih ediyor.

Bu kararı verirken en hassas olduğu faktörler: momentum, trend gücü, breakout / breakdown sinyalleri, momentum kırılması, aşağı yönlü hızlanan hareket.

4. Kullanıcı Sanal Portföy Özeti

Bu oturumda sanal portföye işlenmiş bir kullanıcı işlemi bulunmuyor.

Not: Gerçek B2C ürününde, bu kayıtlar veritabanında tutulup kullanıcıya "ajanı ne kadar takip ettin?", "hangi profile daha uyumlu sonuç alıyorsun?" gibi ek metrikler üretmek için kullanılabilir.

Bu rapor, 'RiskProfile RL – Portföy Koçu' prototipinin akademik/prototip çıktısı olarak üretilmiştir.