

## SISE Hisse Senedi Analiz Raporu

### 1. Sonuc ve Tahminler

Metrik	Tahmin
Sonraki Gun Acilis	38.11 TL
Beklenen En Yuksek	38.31 TL
Beklenen En Dusuk	37.83 TL
Beklenen Kapanis	38.40 TL
Volatilite Beklentisi	Normal (1.56%)
Hacim Durumu	Normal Hacim

#### 1.1 Hacim Bazli Alternatif Senaryolar

Metrik	Yuksek Hacim Senaryosu	Dusuk Hacim Senaryosu
Acilis	38.49 TL	37.92 TL
En Yuksek	39.08 TL	37.93 TL
En Dusuk	38.02 TL	37.08 TL
Kapanis	38.97 TL	38.01 TL

Hacim Analizi: • Mevcut Hacim Durumu: Normal Hacim • Yuksek Hacim Senaryosu: Normal hacmin en az %50 uzerinde islem gerceklesmesi durumu • Dusuk Hacim Senaryosu: Normal hacmin %50'sinin altinda islem gerceklesmesi durumu Not: Hacim artisi genellikle fiyat hareketinin yonunu guclendirir. Yuksek hacimle gelen yukselis daha guclu bir yukselis trendine, dusuk hacimle gelen yukselis ise zayif bir yukselis trendine isaret edebilir.

### 2. Temel Analiz

Metrik	Deger
Son Kapanis	38.02 TL
20 Gunluk Ortalama	39.65 TL
50 Gunluk Ortalama	41.08 TL
RSI	38.98
Volatilite (20 Gunluk)	1.43%

### 3. Teknik Analiz Grafikleri



### 4. Istatistiksel Analiz

• Gunluk Getiri Ortalamasi: -0.06% • Gunluk Getiri Std. Sapma: 1.92% • Shapiro-Wilk Normallik Testi p-degeri: 0.2348 • Carpiklik: -0.14 • Basiklik: 0.48

## 5. Trend ve Momentum Analizi

• Mevcut Trend: Dusus • RSI Durumu: Notr Bolge (38.98) • Momentum: -0.03

## Istatistiksel Analiz Sonuclari ve Yorumlari

Duraganlik Testi (p-değeri: 0.6749):

Fiyat serisi duragan degildir ve trend icerir.

Not: Duraganlik, fiyatların belirli bir ortalamaya etrafında dalgalandığını gösterir. Duragan olmayan seriler genellikle trend icerir ve tahmin yapmak daha zordur.

Normallik Testi (p-değeri: 0.1214):

Getiriler normal dagilimaya uymaktadır.

Not: Normal dagilimaya uygunluk, getirilerin tahmin edilebilirliğini ve risk hesaplamalarının güvenilirliğini etkiler.

Otokorelasyon (-0.0430):

Zayıf bir ardışık ilişki var.

Not: Otokorelasyon, fiyat hareketlerinin birbirini ne kadar etkilediğini gösterir. Yüksek otokorelasyon, trend takip stratejilerinin işe yarayabileceğine işaret eder.

## Risk Analizi ve Değerlendirmesi

Value at Risk (VaR) Analizi:

• %95 güven aralığında maksimum günlük kayıp: -307.82%

• %99 güven aralığında maksimum günlük kayıp: -464.22%

Not: VaR, normal piyasa koşullarında karşılaşılabilecek maksimum kaybı gösterir.

Örneğin, %95 VaR değeri -307.82% ise, günlük kaybın bu değeri aşma olasılığı %5'tir.

Sharpe Oranı: -0.54

Düşük getiri/risk oranı

Not: Sharpe oranı, alınan risk başına elde edilen getiriye ölçer. 1'in üzerindeki değerler iyi performansı gösterir.

Maksimum Düşüş: -7668.09%

Yüksek risk seviyesi

Not: Maksimum düşüş, en yüksek noktadan en düşük noktaya kadar olan kayıp yüzdesini gösterir. Bu değer, yatırımcının karşılaşılabileceği en kötü senaryoyu temsil eder.

## Teknik Analiz: Fibonacci Seviyeleri

Fibonacci Seviyeleri Nedir?

Fibonacci seviyeleri, fiyatın geri çekilme ve ilerleme noktalarını tahmin etmek için kullanılan teknik analiz aracıdır. Bu seviyeler, destek ve direnç noktalarını belirlemede yardımcı olur.

Nasıl Yorumlanır?

- 0.236 ve 0.382: Zayıf destek/direnç seviyeleri
- 0.500: Orta güçte destek/direnç seviyesi
- 0.618 ve 0.786: Güçlü destek/direnç seviyeleri

Fibonacci Seviyesi	Fiyat Seviyesi
Seviye 0.0	37.48
Seviye 0.236	42.19
Seviye 0.382	45.11
Seviye 0.5	47.47
Seviye 0.618	49.82
Seviye 0.786	53.18
Seviye 1.0	57.45

## Genel Değerlendirme ve Özet

Risk Seviyesi: Yüksek

Performans Değerlendirmesi: Zayıf

Önemli Bulgular:

- Hisse senedi Dusus trendinde olup, trend gücü %26.74 seviyesindedir.
- Fiyat hareketleri döngüsel bir örüntü göstermemektedir.
- RSI göstergesi 38.98 seviyesinde olup, hisse nötr bölgesindedir.
- Yıllık volatilité %30.49 seviyesindedir, bu piyasa ortalamasının üzerindedir.
- Getiriler normal dağılıma uymaktadır, risk hesaplamaları daha güvenilirlerdir.
- Maksimum kayıp riski (VaR 95): %-3.08
- Risk/getiri oranı (Sharpe): -0.54

#### Yatırımcı İçin Öneriler:

- Güçlü dususe uygun pozisyon alınabilir.
- Hisse yüksek volatilitéye sahiptir. Portföyün en fazla %5-10'luk kısmında pozisyon alınması önerilir.
- Stop-loss emirleri için %-3.08'lik maksimum kayıp seviyesi referans alınabilir.
- RSI nötr bölgede, trend yönünde pozisyon alınabilir.
- Fibonacci seviyeleri ve destek/direnç noktaları alım-satım kararları için referans olarak kullanılabilir.

## Durağanlık Analizi ve Spesifik Öneriler

1. Trend Bazlı Öneriler (ADX):
  - Güçlü trend devam ediyor, mevcut pozisyonlar korunabilir.
2. Momentum Bazlı Öneriler (ROC):
  - Momentum zayıf, yeni pozisyon açmak için acele edilmemeli.
3. Hacim Bazlı Öneriler:
  - Hacim trendi desteklemiyor, temkinli olunmalı.
4. Volatilité Bazlı Risk Yönetimi:
  - Volatilité normal seviyelerde, standart risk yönetimi uygulanabilir.

5. Teknik Seviye Onerileri:

- Stop-loss için 45.11 seviyesi kullanılabilir.
- Kar realizasyonu için 49.82 - 53.18 aralığı hedeflenebilir.

6. Risk Yonetimi Onerileri:

- Portföy büyüklüğünün %2'sinden fazla risk alınmaması önerilir.
- Normal pozisyon büyüklükleri korunabilir.

7. MFI Bazlı Alım/Satım Onerileri:

- MFI nötr bölgede, mevcut strateji korunabilir.