

BIST Analiz

Hisse Analiz

Hisse İzleyici

Portfolyo Ağırlıkları

Portfolyo Öneri

[LinkedIn](#) [GitHub](#) [Email](#)

[GitHub Sponsor](#) [Patreon](#)

Bu uygulama, bireysel yatırımcıların, yatırım kararlarına kantitatif destek sunabilmek amacıyla hazırlanmıştır.

Uygulama üç bileşenden oluşmaktadır:

1. Hisse Analiz: Seçilen hissenin geçmiş performansını ve istatistiklerini, dönemsel istatistiklerini sunar; seçilen hisseye otomatik olarak teknik analiz yapar, destek/direnç noktalarını belirler ve indikatörleri yorumlar; fiyat hareketlerinin davranışını analiz eder ve en kârlı formasyonları bulmanza yardımcı olur.
2. Hisse İzleyici: Seçilen endeksteki hisselerle, tarafımızdan geliştirilmesi yapılmış özel üç indikatörü uygulayarak, çeşitli periyotlar için (5-22-61 gün) en iyi getiriyi vermesi beklenen hisse senedi en yüksek skoru alacak şekilde tüm hisseler skorlandırır.
3. Portfolyo Öneri: Seçilen endeksin içerdiği hisselerden farklı portfolyolar oluşturur ve performanslarını gösterir.
4. Portfolyo Ağırlıkları: Seçilen hisselerden (en fazla 20 hisse seçilebilir), çeşitli optimal portfolyolar oluşturur ve bunların tarihsel istatistiklerini sunar.

Burada yer alan yatırım bilgi, yorum ve tavsiyeleri yatırım danışmanlığı kapsamında değerlendirilir. Yatırım danışmanlığı hizmeti, kişilerin risk ve getiri tercihleri dikkate alınarak kişiye özel sunulmaktadır. Burada yer alan ve hiçbir şekilde yönlendirici nitelikte olmayan içerik, yorum ve tavsiyeler ise genel niteliktir. Bu tavsiyeler mali durumunuz ile risk ve getiri tercihlerinize uygun olmamayıp. Bu nedenle, sadece burada yer alan bilgilere dayanarak yatırım karar verilmesi beklenirlerine uygun sonuçlar doğurmamalıdır. Bu görüşler mali durumunuz ile risk ve getiri tercihlerinize uygun olmamayıp. Bu nedenle, sadece burada yer alan bilgilere dayanarak yatırım karar verilmesi beklenirlerine uygun sonuçlar doğurmamayıp. Hiçbir şekilde yönlendirici nitelikte olmayan bu içerik, genel anlamda bilgi vermemi amaçlamakta olup; bu içeriğin, müşterilerin ve diğer yatırımcıların alım satım kararlarını destekleyebilecek yeterli bilgileri kapsamasabileceğini dikkate alınmalıdır. Bu sayfada yer alan çeşitli bilgi ve görüşlere dayanarak yapılacak ileriye dönük yatırımlar ve ticari işlemlerin sonuçlarından ya da ortaya çıkabilecek zararlarından geliştirici (Murat Koptur) sorumlu tutulamaz.

Made with ❤️ by [Murat Koptur](#)

BIST Analiz

Hisse Analiz

Hisse İzleyici

Portfolyo Ağırlıklandırıcı

Portfolyo Öneri

Hisse Analiz

Hisse Seçiniz

ASELS.IS - ASELSAN ELEKTRONİK SANAYİ VE TİCARET A.Ş.

Analizi Başlat

Getiri İstatistikleri

Bu kısımda, sol sütunda seçilen hisse senedinin BIST 100 endeksinin geçmiş 3 yıllık günlük grafiği; sağ sütunda ise hisse, endeks ve ajan getirilerin (hisse getirişi eksi endeks getiri) istatistikleri yer almaktadır.

Fiyat Grafiği - Geçmiş 3 Yıl



	Hisse	Endeks	Ajan Getiri
Ortalama	0,0026	0,0028	-0,0002
Standart Sapma	0,0296	0,0189	0,0207
Sharpe Oranı	0,0878	0,1482	-0,0099
Riske Maruz Değer %5	-0,0386	-0,0256	-0,0273
Riske Maruz Değer %1	-0,085	-0,0569	-0,0446
Maksimum Düşüş %	-43,5311	-22,2625	-50,7102

Markov Rejim Değişim Modeli

Markov rejim değişim modeli, hisse senedi getirilerindeki farklı piyasa koşullarını tanımlayarak, yatırımcılara geçişlerin ve dönenmelik değişimlerin analizini sağlar.

Bu model, hisse senedi getirilerini belirli rejimlere ayıracak, yatırımcılara volatilite artışı veya düşüşleri gibi farklı piyasa durumlarında nasıl tepki verebileceklerini konusunda bilgi sağlar.

Markov rejim değişim modeli, geçmiş verileri kullanarak gelecekteki piyasa koşullarını tahmin etmeye yardımcı olarak, yatırımcılara daha etkili ve öngörülü kararlar alma konusunda destek sunar.

Fiyat / Rejim Olasılıkları Grafiği - Geçmiş 3 Yıl



Rejim İstatistikleri	Rejim 1	Rejim 2	Rejim 3
Gün Sayısı	267	419	64
Beklenen Uzunlu (Gün)	32	15	4
Ortalama	0,0004	0,0025	0,0122
Standart Sapma	0,0132	0,0265	0,0702
Sharpe Oranı	0,031	0,0961	0,1737
Riske Maruz Değer %5	-0,0184	-0,0384	-0,0996
Riske Maruz Değer %1	-0,034	-0,0567	-0,1
Maksimum Düşüş %	-18,2383	-39,4917	-30,5323

Geçiş Olasılıkları %	Rejim 1'e	Rejim 2'e	Rejim 3'e
Rejim 1'den	96,89	2,09	0
Rejim 2'den	2,59	93,62	21,2
Rejim 3'den	0,52	4,29	78,8

Otomatik Teknik Analiz

Otomatik teknik analiz modülü, destek / direnç ve Fibonacci retracement seviyelerinin işaretli olarak belirlenmesine yardımcı olur.

Ayrıca, çeşitli indikatörler yardımıyla seçilen hisseye ait daha iyi bir teknik analiz yapılmasına olanak sağlar.

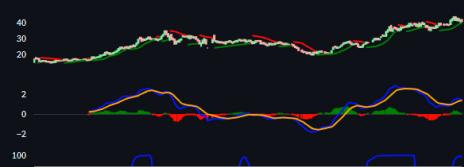
Destek / Direnç Seviyeleri



Fibonacci Retracment

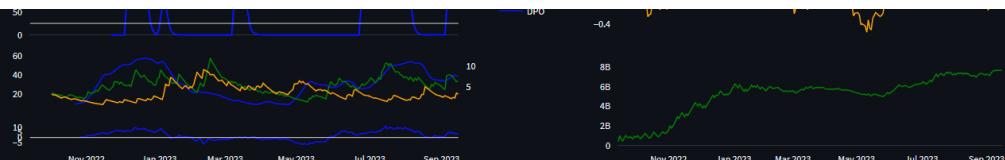


İndikatör Analizi - Momentum & Trend



İndikatör Analizi - Hacim & Oynaklık





ADX indikatörü, trendin güçlü olduğunu göstermektedir.

STC indikatörü, **aşırı alım** göstermektedir.

MACD indikatörü, sinyal çizgisini **kesmedi**.

MACD indikatörü, pozitif bölgede bulunmaktadır, **artan momentum** vardır.

Fiyat, alt PSAR noktasının üzerindeydi, PSAR indikatörü **al** sinyali vermemektedir.

DPO indikatörü ile ikinci periyot arasında ortalama **140** gün olduğu belirlenmiştir.

Fiyat, Keltner Kanalları arasında seyretmektedir.

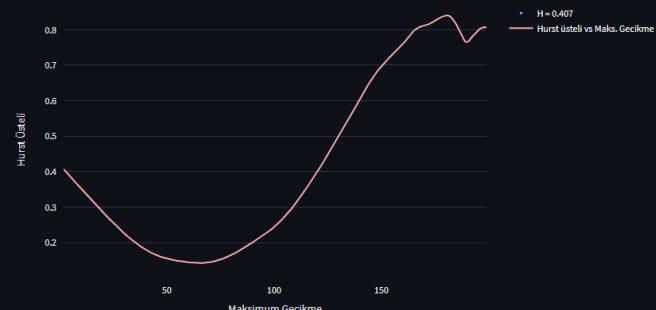
CMF indikatörü, alım/satım baskısı **göstermemektedir**.

OBV indikatörü, **negatif hacim baskısı** göstermektedir, fiyatlar düşebilir.

Hurst Analizi

Hurst Üsteli, zaman serilerinin geçmiş davranışını incelemek ve gelecekteki eğilimleri anlamak için kullanılan bir analiz yöntemidir. Hisse fiyatları gibi finansal verilerde Hurst Üsteli, fiyatların daha uzun vadeli davranışını değerlendirmemize yardımcı olabilir, böylece ortalama dönüslüler, rastgele yürüyüşler veya trendler gibi farklı davranışları tanımlayabilirsiniz.

Hurst Analizi



Seri, Rastsal Yürüyüş serisidir.

Gecikmeler 4 - 116 aralığında iken Hurst katsayı, serinin bir Ortalamaya Dönüş (mean-reverting) serisi olduğunu göstermektedir. Bu, zaman serisinin, ilgili gecikmelerde ortalama değerine döne eğilimi gösterdiğini ve merkezi bir noktaya geri dönmeye olasılığını ima eder.

Gecikmeler 117 - 138 aralığında iken Hurst katsayı, serinin bir Rastsal yürüyüş (random walk) serisi olduğunu göstermektedir. Bu, zaman serisinin zaman içinde öngörülemeyen değişiklikler sergilediği anlamına gelir.

Gecikmeler 139 - 197 aralığında iken Hurst katsayı, serinin bir Trend serisi olduğunu göstermektedir. Bu, ilgili gecikmelerde zaman serisi değerlerinin tutarlı bir yönde hareket ettiğini (net bir yükseliş veya düşüş eğilimi) gösterir.

Price Action

Oluşan formasyonların backtest sonuçları aşağıdaki tabloda yer almaktadır. Kullanılan strateji, formasyon:

- Boğa formasyonu ise alım;
- Ayı formasyonu ise satım;

şeklinde oluşturulmuştur. Siz de bu tabloyu kullanarak, hisse senedi fiyatlarında oluşan formasyonlara göre alım-satım stratejisi oluşturabilirsiniz. Zarar eden formasyonlar için stratejinin tersi uygulanabilir.

Price Action	↓ Getiri	Aşırı Getiri (Al ve Tut stratejisine göre)
Long Legged Doji	1.5882	0.1143
Gravestone Doji	1.5882	0.1143
Doji	1.5882	0.1143
Inverted Hammer	1.5622	0.0882
Rickshaw Man	1.5557	0.0818
Matching Low	1.5557	0.0818
High-Wave Candle	1.529	0.055
Marubozu	1.3871	-0.0868
Closing Marubozu	1.2833	-0.1907
Harami Pattern	1.1671	-0.3068

BIST Analiz

Hisse Analiz

Hisse Izleyici

Portfolyo Ağırlıkları

Portfolyo Öneri

Hisse Izleyici

Endeks Seçiniz

BIST 100

▼

Analizi Başlat

Hisse Izleyici, seçilen endeksteki hisse senetlerini, özel olarak geliştirilmiş bir indikatör yardımıyla sıralar. Bu sayede üç farklı (kısa - orta - uzun) vade için, getirişi en yüksek olması beklenen hisse senedi 1 olmak üzere, tüm hisse senetleri sıralanır.

Hisse	Kısa Vade Beklenen Performans İndikatörü Rangı	Orta Vade Beklenen Performans İndikatörü Rangı	Uzun Vade Beklenen Performans İndikatörü Rangı
IZMDC.IS	3	1	2
PGSUS.IS	15	2	11
THYAO.IS	4	3	9
SAHOLIS	30	4	28
FROTO.IS	5	5	3
AEEFS.IS	47	6	18
GLYHO.IS	31	7	5
AKBNKJIS	12	8	46
TAVHLIS	8	9	10
BERA.IS	79	10	40
YKBNKJIS	50	11	8
KCHOLIS	20	12	12
GARANJIS	40	13	34
MAVLIS	63	14	29
ODAS.IS	42	15	33
EREGL.IS	52	16	31
AKSEN.IS	48	17	51
JKFGYJIS	39	18	36
HEKTS.JS	1	19	78
ECZYT.IS	68	20	75

Vade	Beklenen Getiri
Kısa (5 Gün)	-0.0308
Orta (22 Gün)	0.0894
Uzun (61 Gün)	0.5927

Made with Streamlit

BIST Analiz

Hisse Analiz

Hisse Izleyici

Portfolyo Ağırılıkları

Portfolyo Öneri

Portfolyo Ağırılıklandırıcı

Endeks Seçiniz

BIST 100

Hisse senetlerini seçiniz:

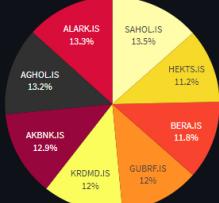
AGHOLIS ✕ AKBNK.IS ✕ ALARK.IS ✕ BERAJIS ✕ SAHOLIS ✕ GUBRF.IS ✕ HEKTS.IS ✕ KRDMD.IS ✕

▼

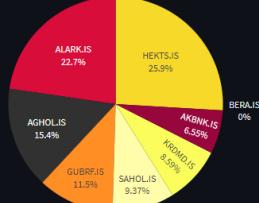
✖ ▾

Analizi Başlat...

Minimum Volatility Portfolio



Maksimum Getirili Portfolio



HEKTS.IS
ALARK.IS
AGHOLIS
AKBNK.IS
GUBRF.IS
SAHOLIS
KRDMD.IS
BERAJIS

Hisse	Ağırlık
AGHOLIS	0.1319
AKBNK.IS	0.1294
ALARK.IS	0.1334
BERAJIS	0.1181
GUBRF.IS	0.1202
HEKTS.IS	0.1117
KRDMD.IS	0.1204
SAHOLIS	0.1349

Hisse	Ağırlık
AGHOLIS	0.1535
AKBNK.IS	0.0656
ALARK.IS	0.2271
BERAJIS	0
GUBRF.IS	0.115
HEKTS.IS	0.2594
KRDMD.IS	0.0859
SAHOLIS	0.0937

	Minimum Volatility	Maksimum Getiri
Cumulative Return %	1,113.27	None
CAGR %	77.7	83.91
Sharpe Ratio	2.34	2.47
Sortino Ratio	3.65	3.88
Max Drawdown %	-42.6	-40.53
Longest Drawdown Days	278	275
Average Drawdown %	-5.44	-4.88
Average Drawdown Days	18	16
Volatility (Annualized %)	39.08	39.06
Expected Daily %	0.33	0.35
Expected Monthly %	6.98	7.41
Expected Yearly %	86.63	93.73
Expected Shortfall (cVAR) %	-5.58	-5.56
Recovery Factor	6.4	7.1
Ulcer Index	0.16	0.15
Serenity Index	1.36	1.65
Cumulative Return % (3-Year)	None	1,308.49

Made with Streamlit

[BIST Analiz](#)[Hisse Analiz](#)[Hisse İzleyici](#)[Portfolyo Ağırılıkları](#)[Portfolyo Öneri](#)

Portfolyo Öneri

Endeks Seçiniz

BIST 50

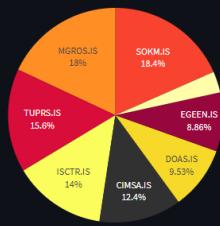
Portfolyo kaç hisse senedi içersin?

3

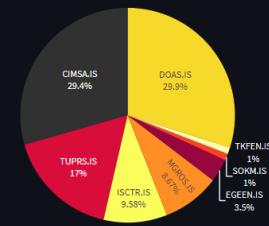
50

Analizi Başlat...

Minimum Volatility Portfolio



Maksimum Getirili Portfolio



- DOMJS
- CIMSAJS
- TUPRSIS
- ISCTRJS
- MGROSJS
- EGENJS
- SOKMJS
- TKFENJS

	Minimum Volatility	Maksimum Getiri
Cumulative Return %	1,152.27	None
CAGR %	79	85.26
Sharpe Ratio	1.96	2.26
Sortino Ratio	3.35	3.76
Max Drawdown %	-37.27	-33.88
Longest Drawdown Days	313	287
Average Drawdown %	-6.14	-5.13
Average Drawdown Days	24	19
Volatility (Annualized %)	49.54	44.04
Expected Daily %	0.34	0.36
Expected Monthly %	7.07	7.5
Expected Yearly %	88.12	95.26
Expected Shortfall (cVaR) %	-6.94	-6.36
Recovery Factor	7.76	8.76
Ulcer Index	0.17	0.14
Serenity Index	1.56	1.93
Cumulative Return % (3-Year)	None	1,353.7

Made with Streamlit