

# RİSKOMETRE

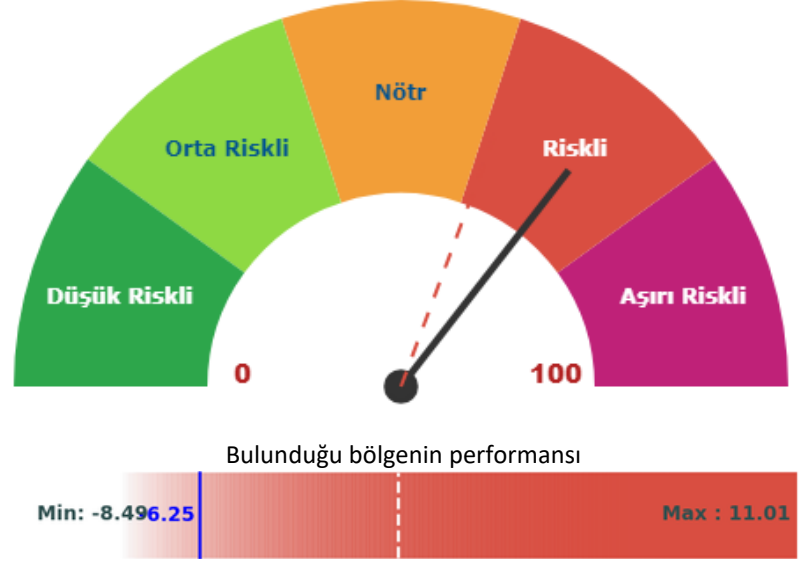
BIST100

12 - 18 Ağustos 2024

Geçtiğimiz hafta **riskli bölgeye** geçen BIST100 modeli bu hafta aşırı riskli yöne ilerleyişini sürdürmüştür.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftada BIST100 endeksi yaklaşık **%3.5 değer kaybetmiştir**. Model riskli bölgeye girdiğinden beri endeksin getirisi bu bölgedeki tarihi ortalamasının altında bulunmaktadır.

Bu hafta **71** Bir hafta önce **61** Bir ay önce **50**

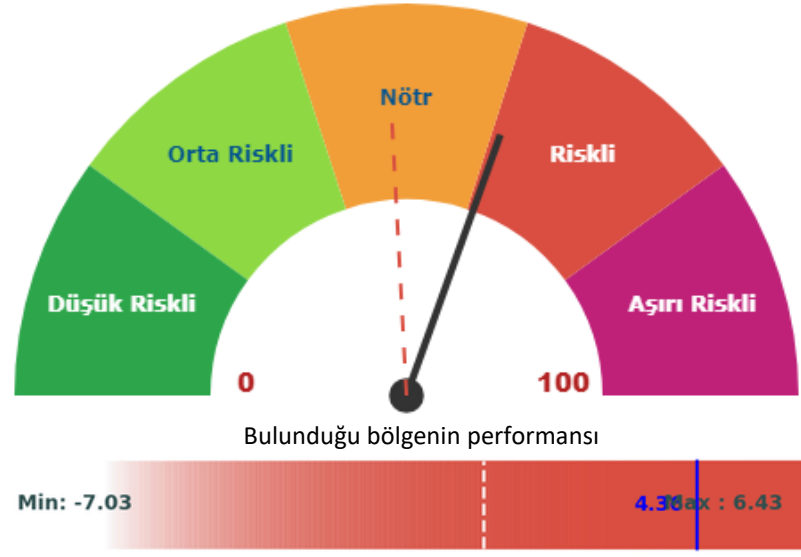


## BIST TEKNOLOJİ

BIST Teknoloji modeli 1 haftalık dönemde nötr bölgeden **riskli bölgeye** geçiş yapmıştır.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftada BIST Teknoloji Endeksi yaklaşık **%3 değer kaybederken**, model riskli bölgeye girdiğinden beri endeksin performansı tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır.

Bu hafta **61** Bir hafta önce **48** Bir ay önce **46**

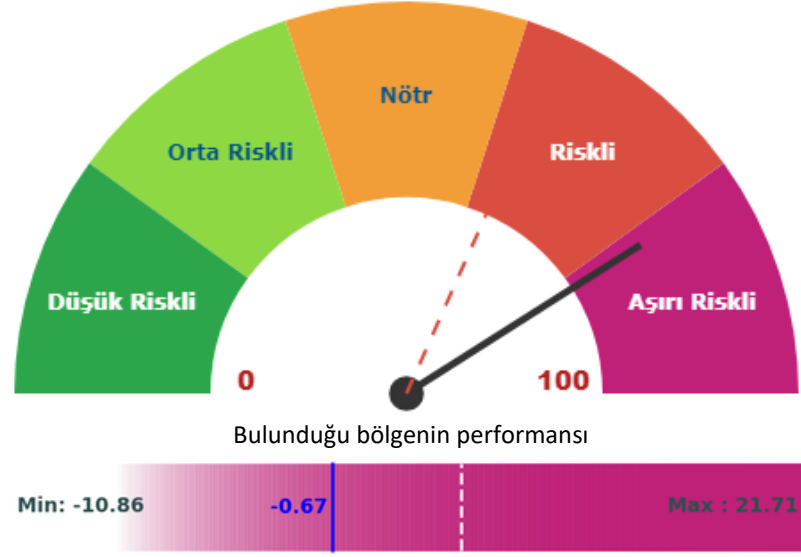


## BIST BANKACILIK

BIST Bankacılık modeli bu hafta nötr bölgeden **aşırı riskli bölgeye** geçmiştir.

BIST Bankacılık Endeksi modelin riskli yöne ilerlediği 1 ayda yaklaşık **%6 değer kaybetmiştir**. Model riskli bölgeye girdiğinden beri endeksin getiri performansı tarihsel ortalamasının altında bulunmaktadır.

Bu hafta **82** Bir hafta önce **63** Bir ay önce **50**

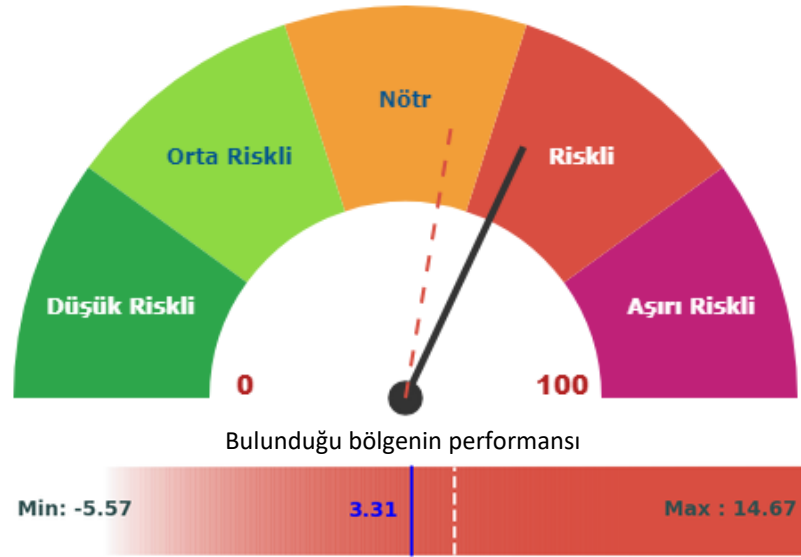


## BIST SINAI

BIST Sınai modeli bu hafta riskli yöne ilerleyerek nötr bölgeden **riskli bölgeye** geçiş yapmıştır.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftada BIST Sınai Endeksi yaklaşık **%4.5 değer kaybetmiştir**. Model riskli bölgeye girdiğinden beri endeksin getirisi tarihsel ortalamasının altında yer almaktadır.

Bu hafta **64** Bir hafta önce **55** Bir ay önce **52**

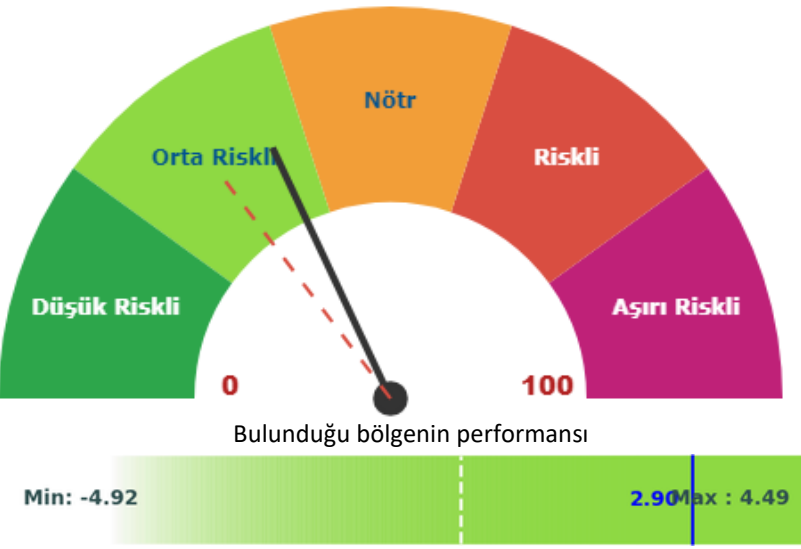


## ALTIN

Altın modeli 1 aylık dönemde **orta riskli bölge** içinde yer alırken bu hafta riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 ayda Altın fiyatları yaklaşık **%1 değer kaybetmiştir**. Model orta riskli bölgeye girdiğinden beri Altının getirisi bu bölgedeki tarihsel maksimum değeri yakınlarında yer almaktadır.

Bu hafta **36** Bir hafta önce **29** Bir ay önce **29**



# RİSKOMETRE

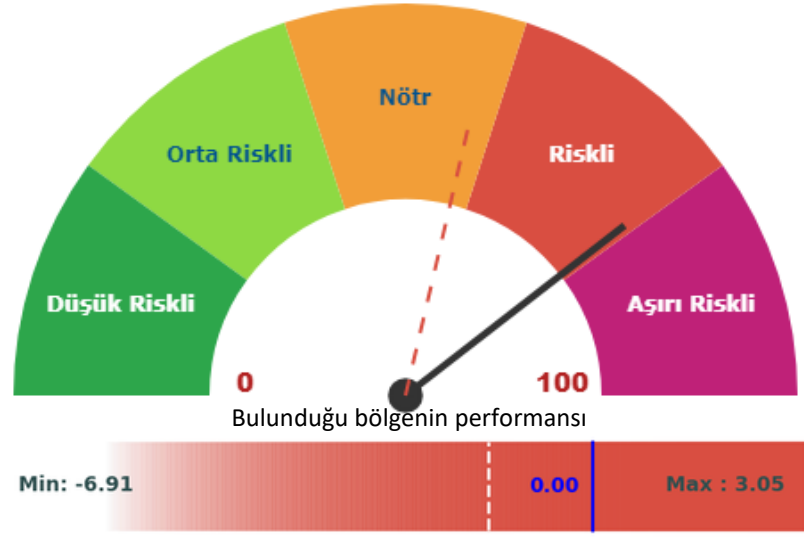
S&P

12 - 18 Ağustos 2024

ABD Hisse Senedi modeli 1 aylık dönemde riskli yöne ilerleyişini sürdürürken uzun zaman sonra **riskli bölgeye** geçiş yapmıştır.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 ayda S&P Endeksi **yaklaşık %5 değer kaybetmiştir**. Model riskli bölgeye girdiğinden beri endeks **getirisi bu bölgedeki tarihsel ortalamasının üzerinde seyretmektedir**.

Bu hafta **79** Bir hafta önce **57** Bir ay önce **33**

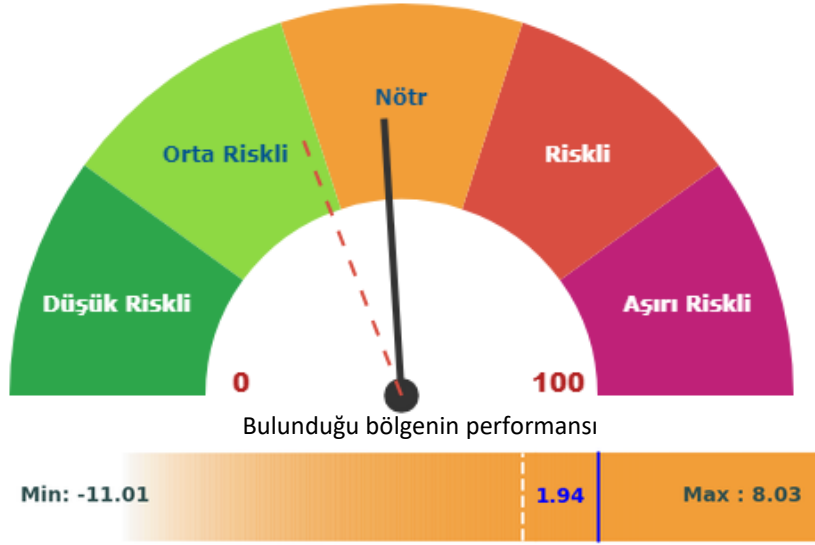


## NASDAQ

Hafta başında riskli bölgeyi test eden NASDAQ modeli haftayı **nötr bölgede** tamamlamıştır.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 ayda NASDAQ Endeksi **yaklaşık %9 değer kaybetmiştir**. Model nötr bölgeye girdiğinden beri endeksin **getirisi bu bölgedeki tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır**.

Bu hafta **48** Bir hafta önce **38** Bir ay önce **14**

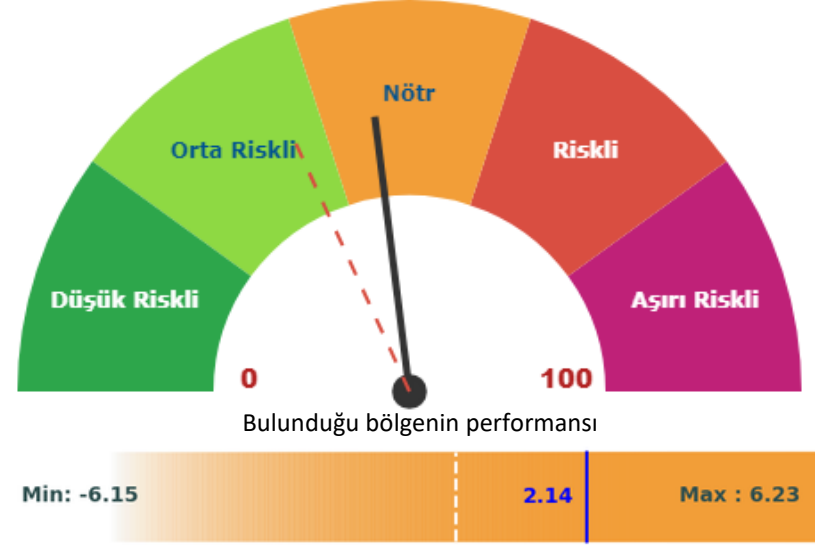


## DAX

Almanya Hisse Senedi modeli 1 haftalık dönemde orta riskli bölgeden **nötr bölgeye** geçiş yapmıştır.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 ayda DAX Endeksi **yaklaşık %9 değer kaybetmiştir**. Model orta riskli bölgeye girdiğinden beri endeksin **getirisi bu bölgedeki ortalamasının üzerinde bulunmaktadır**.

Bu hafta **46** Bir hafta önce **32** Bir ay önce **26**

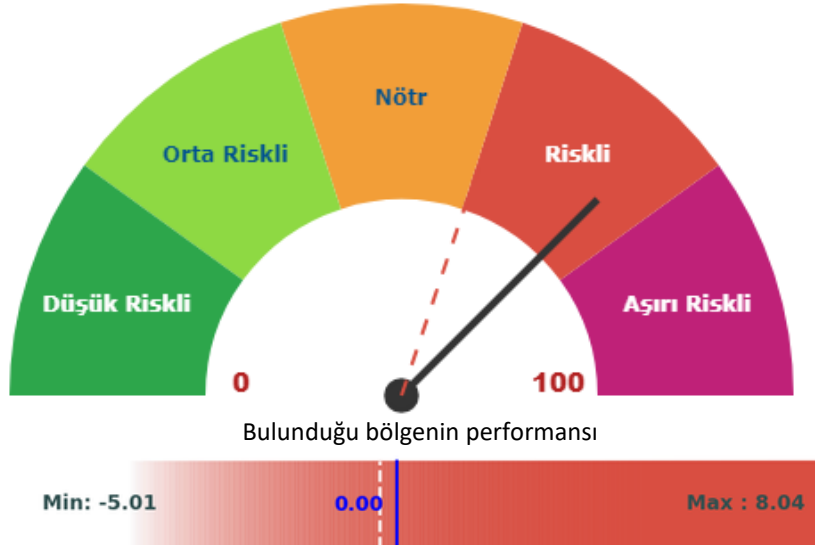


## NIKKEI

Japonya Hisse Senedi Modeli hafta başında aşırı riskli bölge maksimum noktasını test ederek **riskli bölgeye** dönüş yapmıştır.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 ayda Nikkei Endeksi **yaklaşık %17 değer kaybetmiştir**. Model riskli bölgeye girdiğinden beri endeks **performansı bu bölgedeki tarihsel ortalamasına yakın seyretmektedir**.

Bu hafta **76** Bir hafta önce **60** Bir ay önce **39**

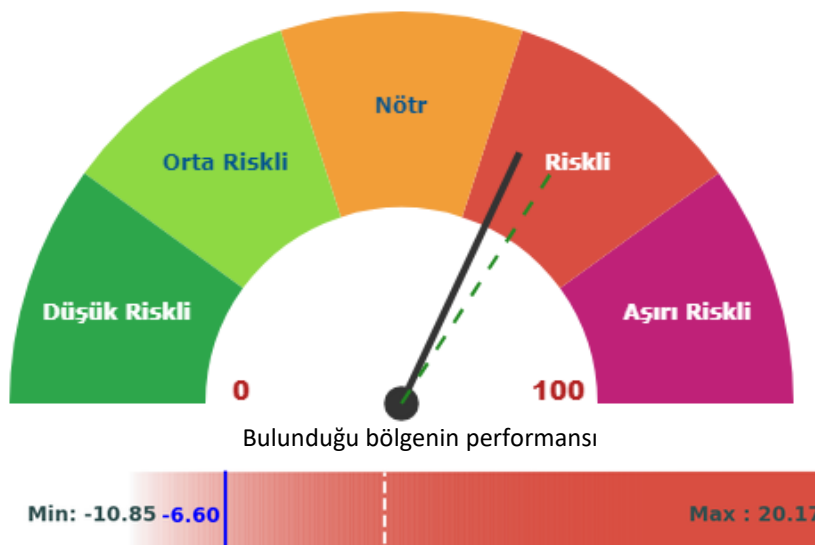


## PETROL

Petrol modeli 1 aylık dönemde **riskli bölge** içinde hafif dalgalı seyretmektedir.

Modelin riskli sinyali verdiği 1 ayda Petrol fiyatları yaklaşık **%7 değer kaybetmiştir**. Model riskli bölgeye girdiğinden beri petrol fiyatlarının **getirisi tarihsel ortalamasının altında bulunmaktadır**.

Bu hafta **64** Bir hafta önce **68** Bir ay önce **65**



# RİSKOMETRE

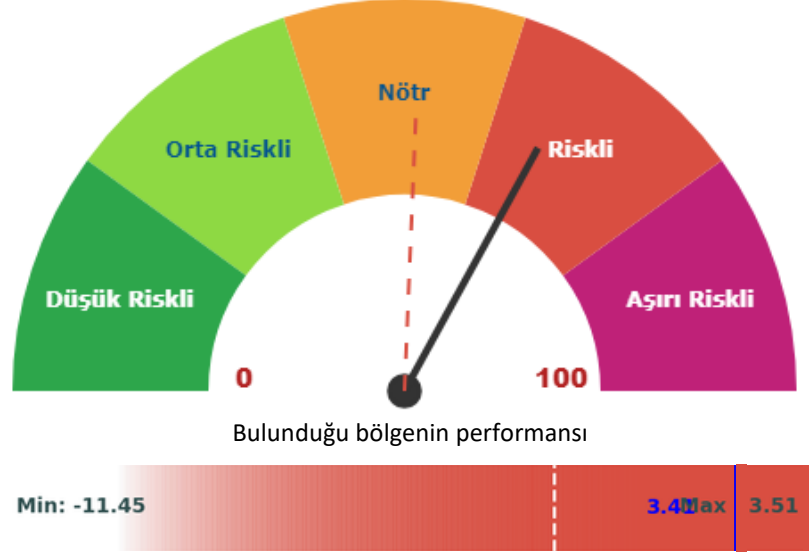
## GÜMÜŞ

12 - 18 Ağustos 2024

Gümüş modeli 1 ayda orta riskli bölgeden **riskli bölgeye** geçiş yapmıştır.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 ayda Gümüş fiyatları yaklaşık **%11 değer kaybederken** model riskli bölgeye girdiğinden beri gümüşün performansı bu bölgedeki tarihsel maksimum değeri yakınlarında bulunmaktadır.

Bu hafta **66** Bir hafta önce **51** Bir ay önce **27**

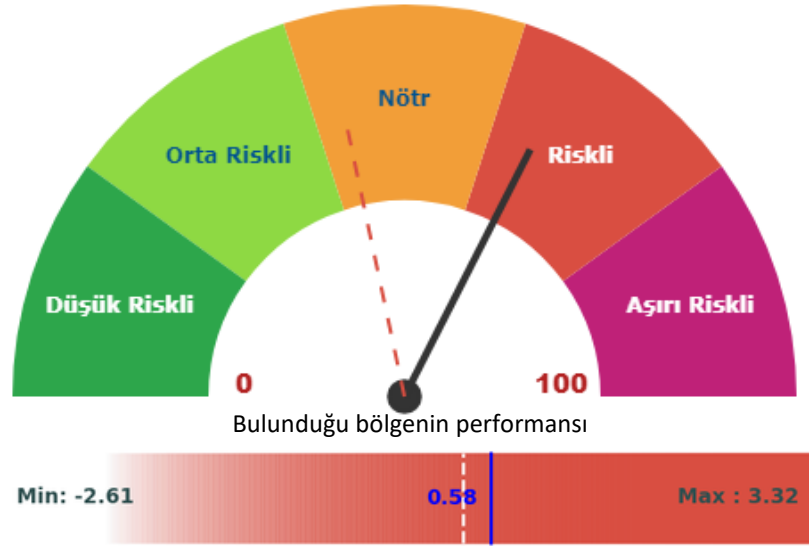


## GBPUSD

GBPUSD modeli 1 aylık dönemde ve bu hafta riskli yöne ilerleyerek **riskli bölgeye** geçiş yapmıştır.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 ayda GBPUSD paritesi yaklaşık **%2 değer kaybetmiştir**. Model riskli bölgeye girdiğinden beri parite **getirisi bu bölge içinde sağladığı ortalama getirinin üzerinde yer almaktadır**.

Bu hafta **65** Bir hafta önce **43** Bir ay önce **39**

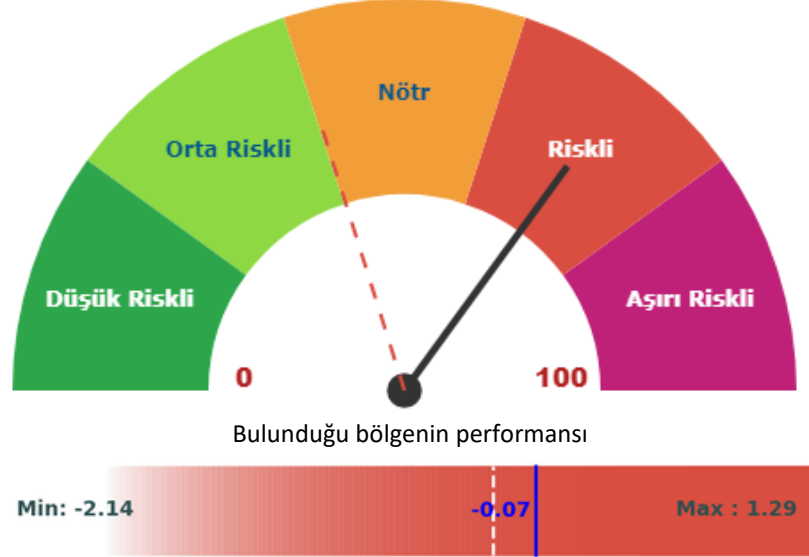


## EURUSD

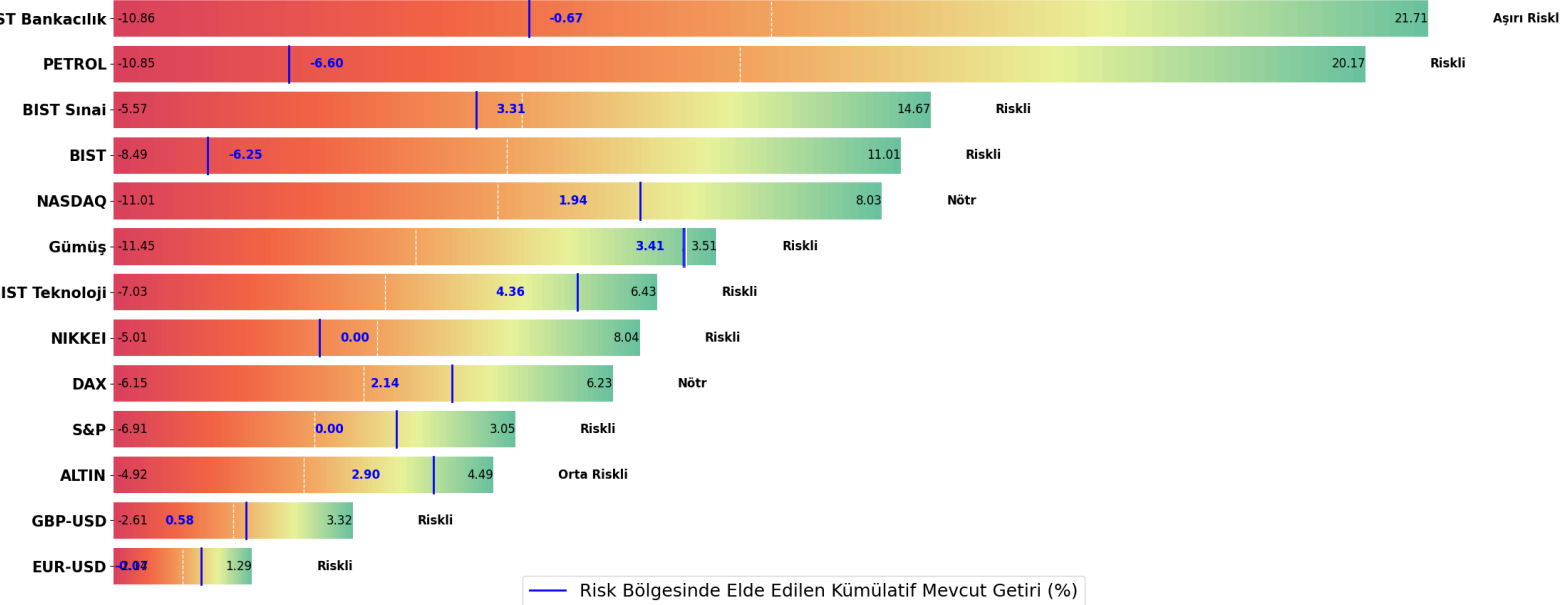
EURUSD modeli bu hafta nötr bölgeden **riskli bölgeye** geçiş yapmıştır.

Modelin dalgalı seyrettiği 1 ayda EURUSD paritesi **getirisi stabil** kalmıştır. Model riskli bölgeye girdiğinden beri parite **getirisi tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır**.

Bu hafta **70** Bir hafta önce **40** Bir ay önce **44**

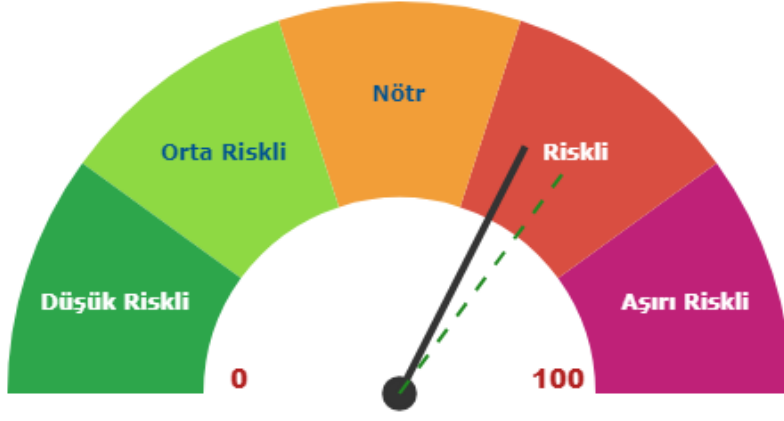


## Bulunduğu Bölgeye Göre Getiri Bantları



\*Grafikte sunulan veriler, ilgili varlık modelinin mevcut bulunduğu risk bölgesi içerisinde kaydedilen kümülatif minimum ve maksimum getiri oranlarını temsil etmektedir. Kesikli beyaz renkli çizgi ise risk bölgesinde elde ettiği ortalama getiriyi göstermektedir. Mavi renkte işaretlenen çizgi, varlık modelinin söz konusu **risk bölgesine giriş yaptığı andan itibaren** elde ettiği mevcut getiriyi göstermektedir.

## RİSKOMETRE NEDİR?



Riskometre makine öğrenimi teknikleri kullanılarak geliştirilmiş matematiksel modellerimizin bir çıktısıdır. Riskometre piyasanın risk algısını ölçerek finansal piyasalardaki belirsizlik ve potansiyel kayıplara karşı finansal risk analizi yapar.

Değerler 100'e (Aşırı Riskli) yakın olduğunda, piyasa daha temkinli ve riskten kaçınma eğiliminde olurken **getiri beklentisinin düşük dalgalanma hareketinin yüksek** olması öngörülmektedir, değerler 0'a (Düşük Riskli) yaklaştığında piyasa daha cesaretli ve risk almayı benimseyen bir yaklaşım sergiler, bu yöne ilerledikçe **getiri beklentisi artar, dalgalanma hareketi azalır**.

Grafikte belirtilen kesik çizgi modelin bir hafta önceki seviyesini göstermektedir.

Bu rapor ArfCap tarafından hazırlanmaktadır. Detaylı içerik:

[www.arf.capital](http://www.arf.capital)

arfcap

## Önemli Bilgilendirme:

“Burada yer alan yatırım bilgi, yorum ve tavsiyeleri yatırım danışmanlığı kapsamında değildir. 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 niteliktedir. Bu tavsiyeler mali durumunuz ile risk ve getiri tercihlerinize uygun olmayabilir. Bu nedenle, sadece burada yer alan bilgilere dayanılarak yatırım kararı verilmesi beklentilerinize uygun sonuçlar doğurmayabilir.

Burada yer alan bilgiler Fibabanka A.Ş. tarafından genel bilgilendirme amacı ile hazırlanmıştır. Yatırım Danışmanlığı hizmeti; aracı kurumlar, portföy yönetim şirketleri, mevduat kabul etmeyen bankalar ile müşteri arasında imzalanacak Yatırım Danışmanlığı sözleşmesi çerçevesinde sunulmaktadır. Burada yer alan yorum ve tavsiyeler yorum ve tavsiyede bulunanların kişisel görüşlerine dayanmakta olup, herhangi bir yatırım aracının alım-satım önerisi ya da getiri vaadi olarak yorumlanmamalıdır. Bu görüşler mali durumunuz ile risk ve getiri tercihlerinize uygun olmayabilir. Bu nedenle, sadece burada yer alan bilgilere dayanarak yatırım kararı verilmesi beklentilerinize uygun sonuçlar doğurmayabilir. Hiçbir şekilde yönlendirici nitelikte olmayan bu içerik, genel anlamda bilgi vermeyi amaçlamakta olup; bu içeriğin, müşterilerin ve diğer yatırımcıların alım satım kararlarını destekleyebilecek yeterli bilgileri kapsamayabileceği dikkate alınmalıdır. Bu sayfalarda yer alan çeşitli bilgi ve görüşlere dayanılarak yapılacak ileriye dönük yatırımlar ve ticari işlemlerin sonuçlarından ya da ortaya çıkabilecek zararlardan Fibabanka A.Ş sorumlu tutulamaz.”