

RİSKOMETRE

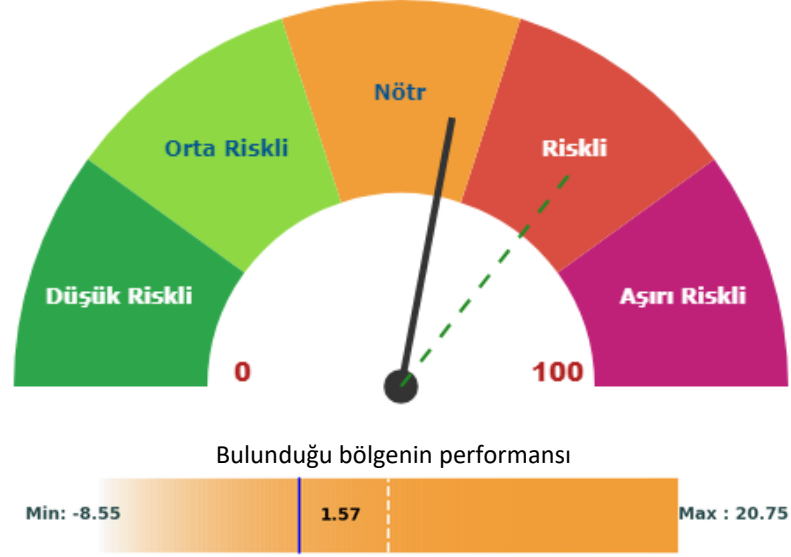
BIST100

19 - 25 Ağustos 2024

1 aylık dönemde riskli yöne ilerleyen BIST100 modeli bu hafta düşük riskli yöne ilerleyerek **nötr bölgeye** geçiş yapmıştır.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 ayda BIST100 endeksi yaklaşık **%10.5 değer kaybı yaşamıştır**. Model nötr bölgeye girdiğinden beri endeksin **getirisi bu bölgedeki tarihi ortalamasının altında bulunmaktadır**.

Bu hafta **56** Bir hafta önce **71** Bir ay önce **50**

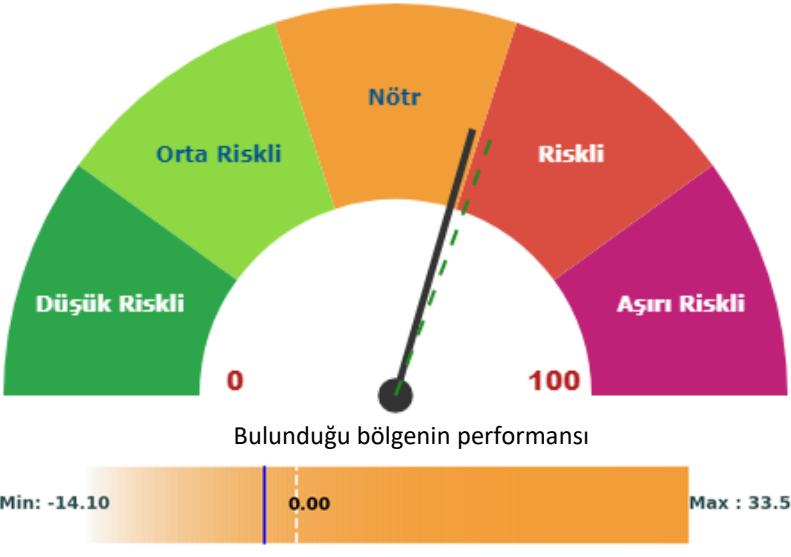


BIST TEKNOLOJİ

Geçtiğimiz hafta riskli bölgeyi test eden BIST Teknoloji modeli bu hafta **nötr bölgeye** geçiş yapmıştır.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 ayda BIST Teknoloji Endeksi yaklaşık **%4.5 değer kaybederken**, model nötr bölgeye girdiğinden beri endeksin performansı **tarihsel ortalamasının altında yer almaktadır**.

Bu hafta **59** Bir hafta önce **61** Bir ay önce **47**

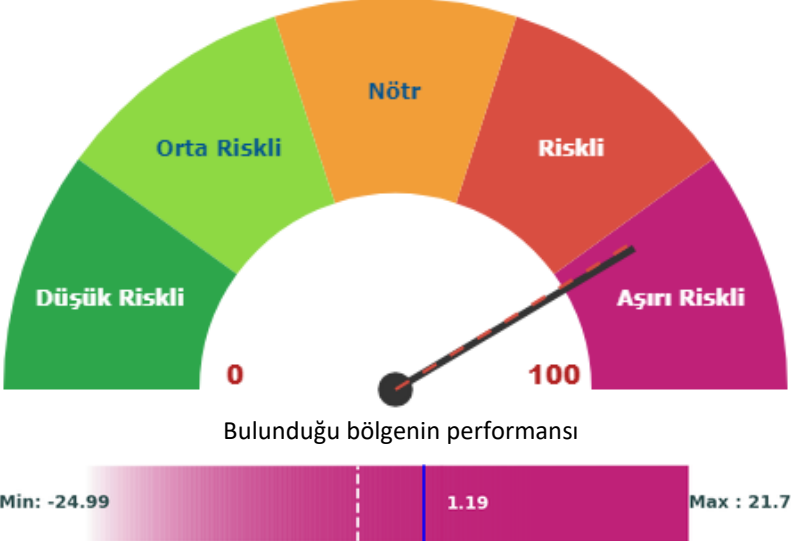


BIST BANKACILIK

1 ayda nötr bölgeden **aşırı riskli bölgeye** geçen BIST Bankacılık modeli bu hafta da aşırı riskli sinyali vermeye devam ediyor.

BIST Bankacılık Endeksi modelin riskli yöne ilerlediği 1 ayda yaklaşık **%15.5 değer kaybetmiştir**. Model aşırı riskli bölgeye girdiğinden beri endeksin **getiri performansı tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır**.

Bu hafta **83** Bir hafta önce **82** Bir ay önce **49**



BIST SINAI

BIST Sınai modeli 1 aylık dönemde **riskli yöne** ilerlerken bu hafta yönünü terse düşük riskli yöne doğru çevirmiştir.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 ayda BIST Sınai Endeksi yaklaşık **%8 değer kaybetmiştir**. Model riskli bölgeye girdiğinden beri endeksin **getirisi tarihsel ortalamasının yakınlarında yer almaktadır**.

Bu hafta **63** Bir hafta önce **64** Bir ay önce **50**

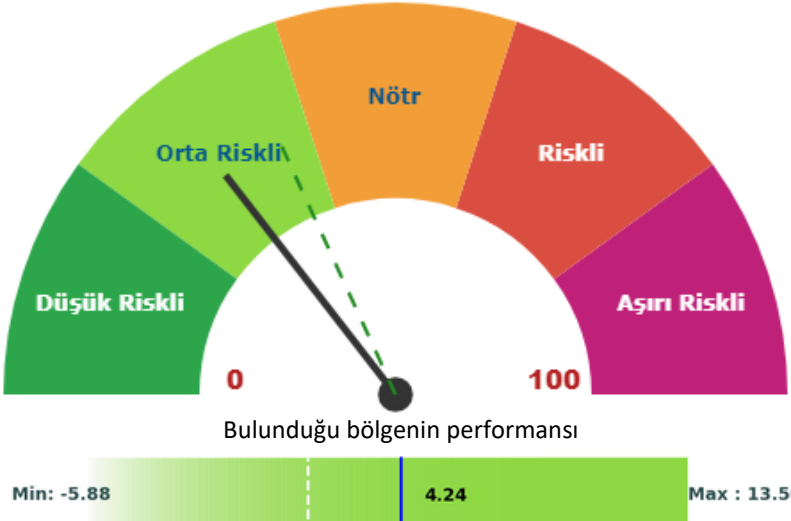


ALTIN

1 haftada **orta riskli bölge** içinde düşük riskli yöne ilerleyen Altın modeli 1 ay önceki konumuna dönüş yapmıştır.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada Altın fiyatları yaklaşık **%1 değer kazanmıştır**. Model orta riskli bölgeye girdiğinden beri Altının **getirisi bu bölgedeki tarihsel ortalamasının üzerinde yer almaktadır**.

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



RİSKOMETRE

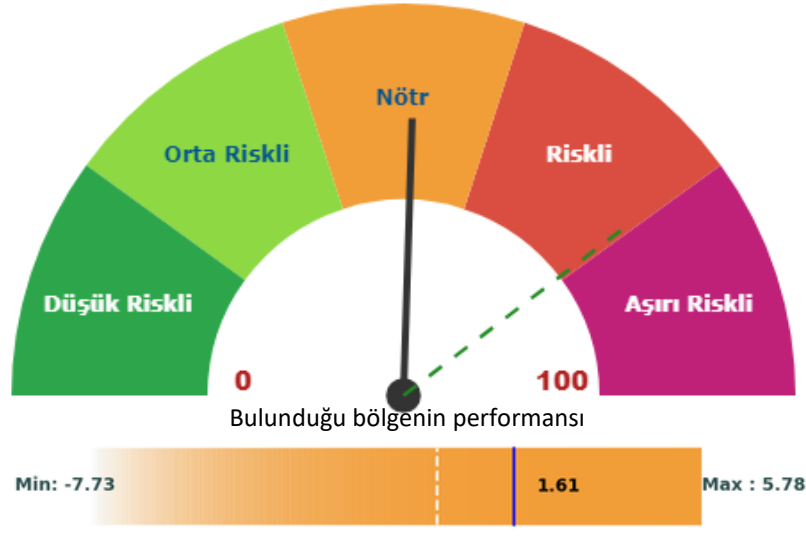
S&P

19 - 25 Ağustos 2024

Geçtiğimiz hafta riskli bölgede yer alan ABD Hisse Senedi modeli bu hafta **nötr bölgeye** geçiş yapmıştır.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada S&P Endeksi **yaklaşık %4.5 değer kazanmıştır**. Model nötr bölgeye girdiğinden beri endeks **getirisi bu bölgedeki tarihsel ortalamasının üzerinde seyretmektedir**.

Bu hafta **51** Bir hafta önce **79** Bir ay önce **38**

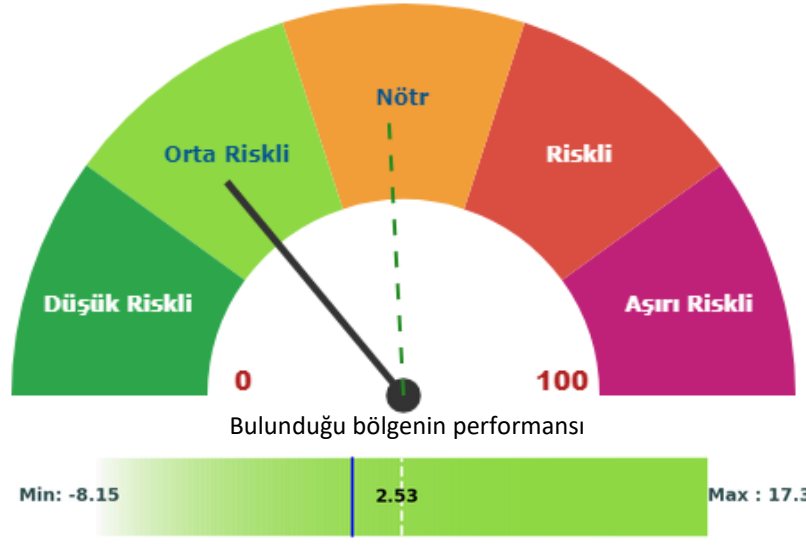


NASDAQ

Geçen hafta nötr bölgeye geçen NASDAQ modeli bu hafta **orta riskli bölgeye** dönüş yapmıştır.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada NASDAQ Endeksi **yaklaşık %6 değer kazanmıştır**. Model orta riskli bölgeye girdiğinden beri endeksin **getirisi tarihsel ortalamasının altında bulunmaktadır**.

Bu hafta **28** Bir hafta önce **48** Bir ay önce **21**

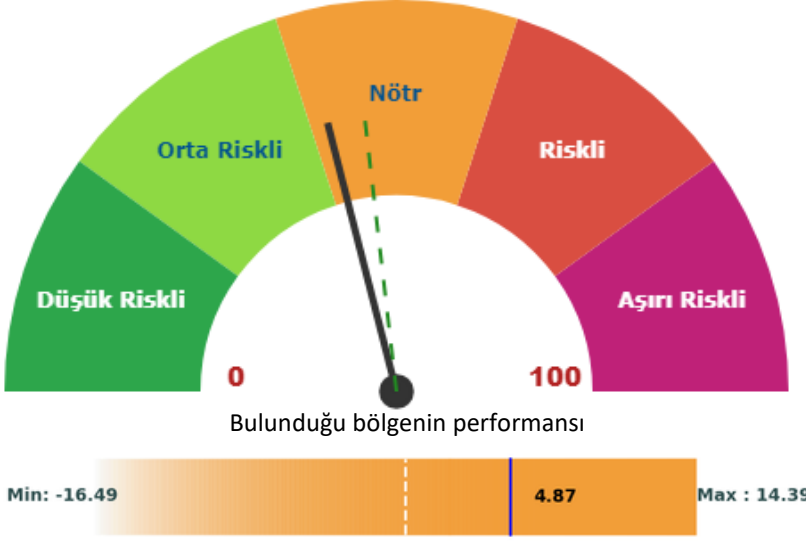


DAX

Almanya Hisse Senedi modeli 1 aylık dönemde riskli yöne ilerlerken bu hafta **nötr bölge** içinde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada DAX Endeksi **yaklaşık %3 değer kazanmıştır**. Model nötr bölgeye girdiğinden beri endeksin **getirisi bu bölgedeki ortalamasının üzerinde bulunmaktadır**.

Bu hafta **42** Bir hafta önce **46** Bir ay önce **28**



NIKKEI

Japonya Hisse Senedi Modeli 1 haftalık dönemde aşırı riskli bölgeden **orta riskli bölgeye** geçiş yapmıştır.

Modelin düşük riskli yöne dalgalı olarak ilerlediği 1 ayda Nikkei Endeksi **yaklaşık %9.5 değer kazanmıştır**. Model bu bölgeye girdiğinden beri endeks **performansı bu bölgedeki tarihsel ortalamasına yakın seyretmektedir**.

Bu hafta **39** Bir hafta önce **82** Bir ay önce **46**

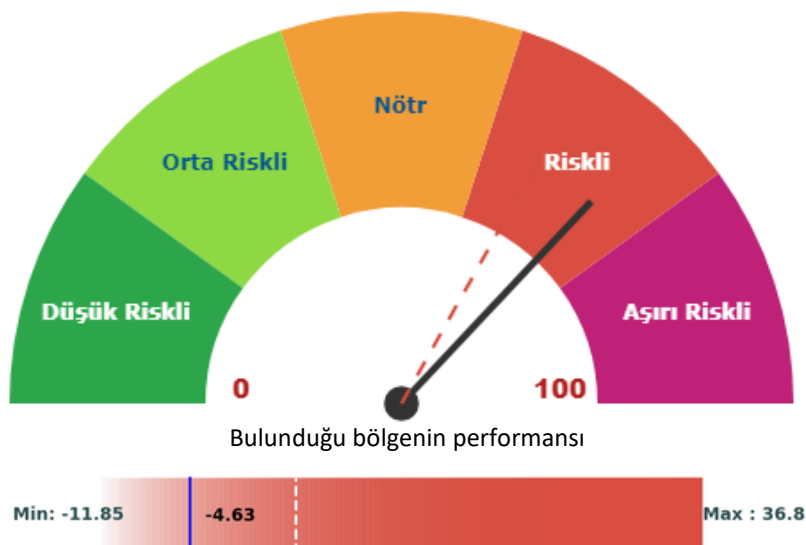


PETROL

Petrol modeli 1 aylık dönemde **riskli bölge** içinde yer alırken bu hafta aşırı riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin riskli sinyali verdiği 1 ayda Petrol fiyatları **yaklaşık %2.5 değer kaybetmiştir**. Model riskli bölgeye girdiğinden beri petrol fiyatlarının **getirisi tarihsel ortalamasının altında yer almaktadır**.

Bu hafta **74** Bir hafta önce **64** Bir ay önce **65**



RİSKOMETRE

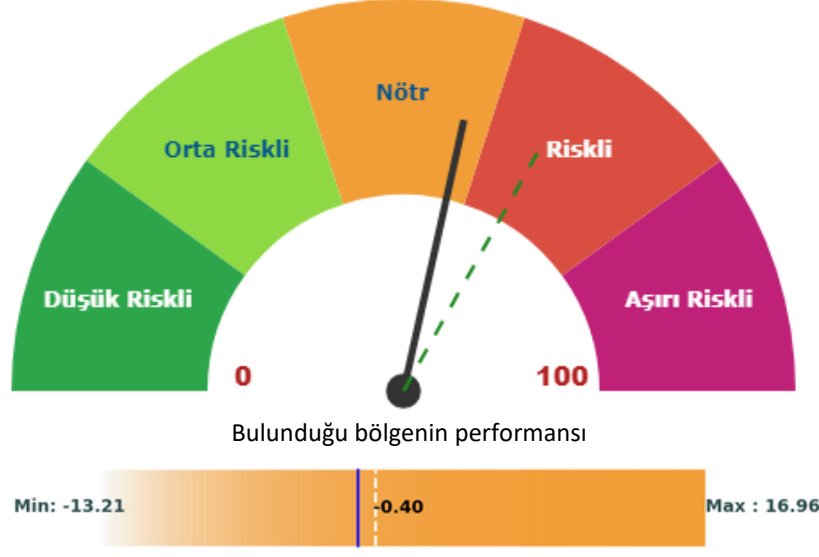
GÜMÜŞ

19 - 25 Ağustos 2024

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

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 ayda Gümüş fiyatları yaklaşık **%3.5 değer kaybederken** model nötr bölgeye girdiğinden beri gümüşün performansı **bu bölgedeki tarihsel ortalamasının yakınında bulunmaktadır.**

Bu hafta **57** Bir hafta önce **66** Bir ay önce **37**

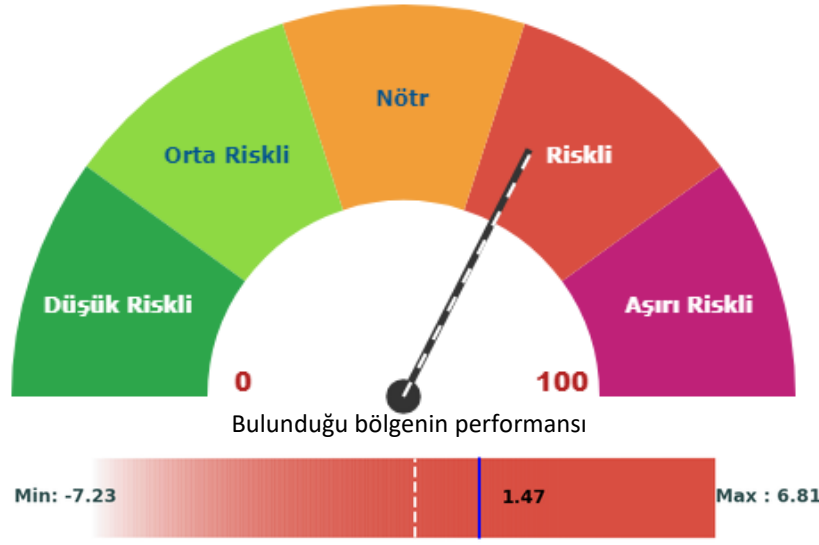


GBPUSD

GBPUSD modeli 1 aylık dönemde riskli yöne ilerlerken bu hafta **riskli bölge** içinde stabil seyretmiştir

Modelin konumunu koruduğu 1 haftada GBPUSD paritesi yaklaşık **%1 değer kazanmıştır.** Model riskli bölgeye girdiğinden beri parite **getirisi bu bölge içinde sağladığı ortalama getirinin üzerinde yer almaktadır.**

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

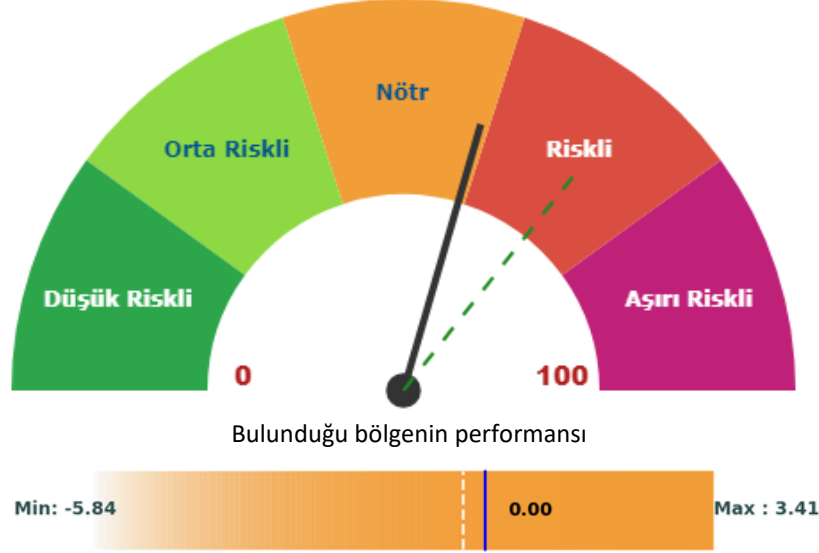


EURUSD

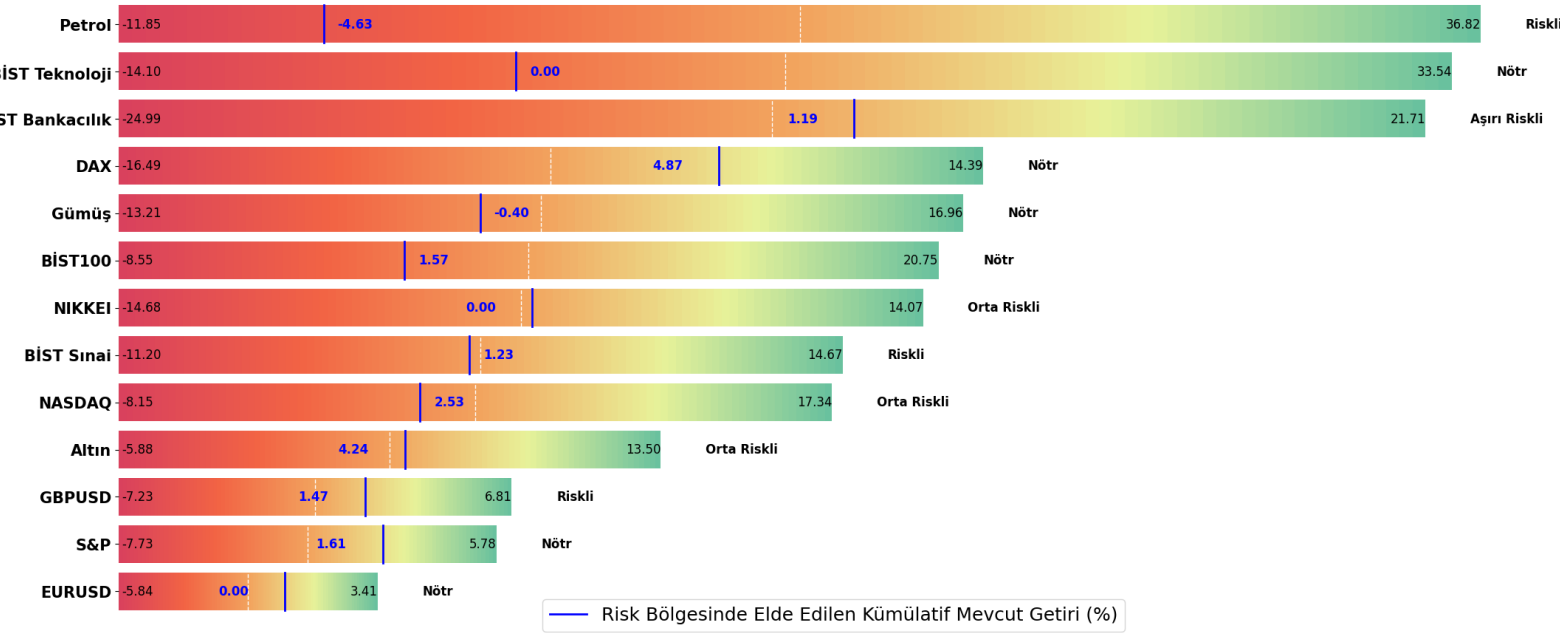
EURUSD modeli bu hafta riskli bölgeden **nötr bölgeye** geçiş yapmıştır.

Modelin dalgalı seyrettiği 1 ayda EURUSD paritesi yaklaşık **%1 değer kazanmıştır.** Model nötr bölgeye girdiğinden beri parite **getirisi tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır.**

Bu hafta **59** Bir hafta önce **70** Bir ay önce **38**

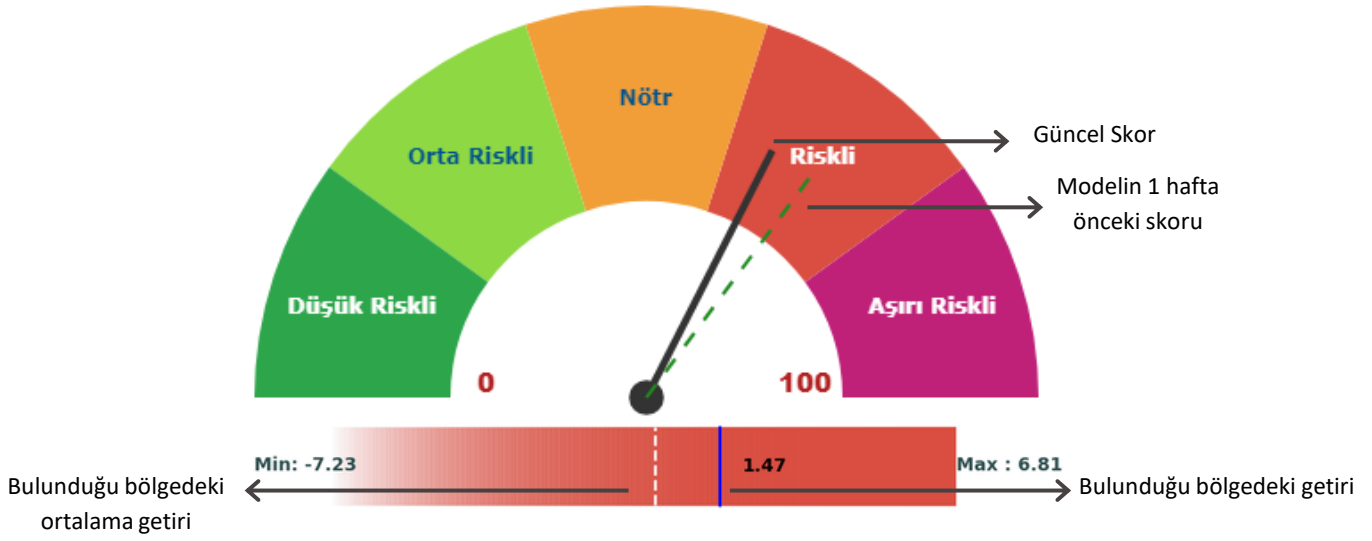


Bulduğu Bölgeye Göre Getiri Bantları



*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:



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."