

RİSKOMETRE

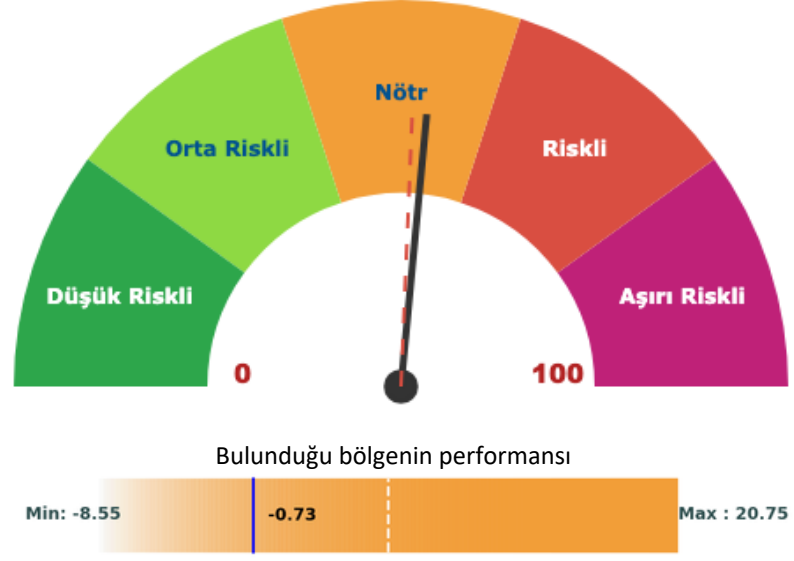
BIST100

2 - 8 Eylül 2024

BIST 100 modeli **nötr bölge** içinde bu hafta riskli yöne ilerlerken 1 aylık dönemde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

BIST100 Endeksi, modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftada **%1.49 değer kaybetmiştir**. BIST100 Endeksi performansı, model nötr bölgeye girdiğinden beri bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altındadır**.

Bu hafta **53** Bir hafta önce **51** Bir ay önce **58**

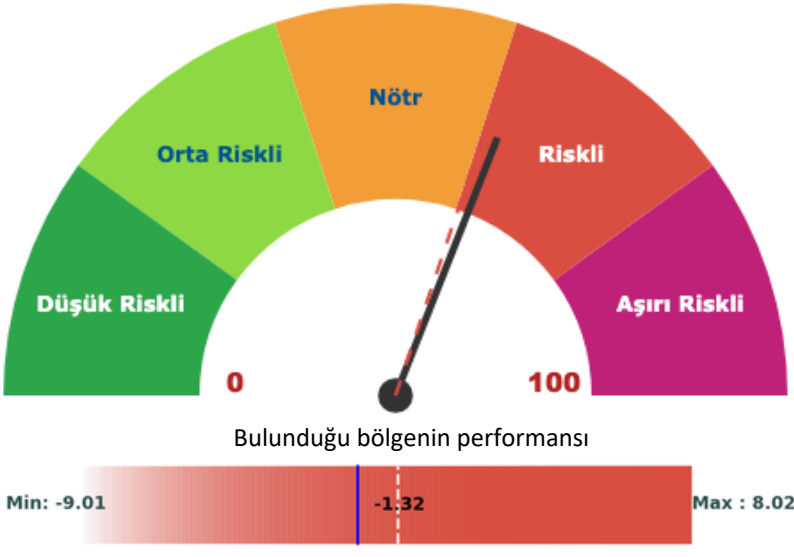


BIST TEKNOLOJİ

BIST Teknoloji modeli bu hafta **riskli bölgeye** geçmiştir

Model 1 ayda riskli yöne ilerlerken BIST Teknoloji Endeksi yaklaşık **%13.5 kayıp yaşamıştır**. BIST Teknoloji Endeksi performansı, model riskli bölgeye girdiğinden beri **tarihsel ortalamasının altında bulunmaktadır**.

Bu hafta **62** Bir hafta önce **60** Bir ay önce **48**

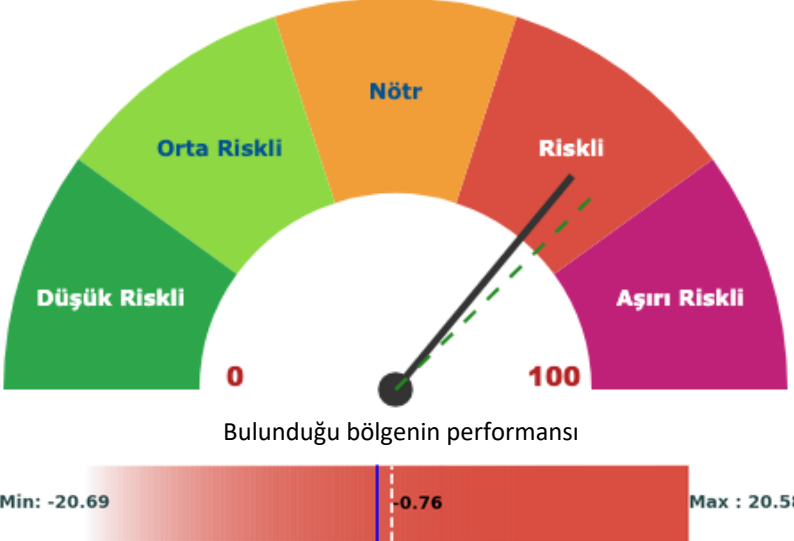


BIST BANKACILIK

BIST Bankacılık modeli **riskli bölge** içinde düşük riskli yönde ilerlemiştir.

BIST Bankacılık Endeksi, modelin riskli yöne ilerlediği 1 ayda **%9.51 değer kaybetmiştir**. BIST Bankacılık Endeksi performansı, model riskli bölgeye girdiğinden beri **ortalamanın altında seyretmektedir**.

Bu hafta **72** Bir hafta önce **75** Bir ay önce **62**

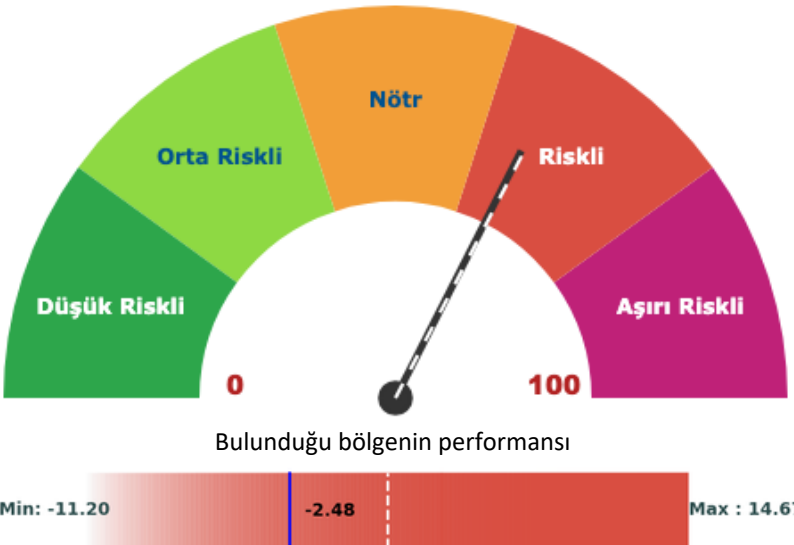


BIST SINAI

1 aylık dönemde riskli yöne ilerleyen BIST Sınai modeli bu hafta **riskli bölge** içinde konumunu korumuştur.

BIST Sınai Endeksi, modelin riskli yöne ilerlediği 1 ayda **%9.66 değer kaybetmiştir**. BIST Sınai Endeksi performansı, model riskli bölgeye girdiğinden beri **ortalamanın altında seyretmektedir**.

Bu hafta **65** Bir hafta önce **65** Bir ay önce **53**



ALTIN

Altın modeli 1 ayda **orta riskli bölge** içinde düşük riskli yöne ilerlerken bu hafta konumunu korumuştur.

Altın, modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda **%2.89 değer kazanmıştır**. Altın performansı, model orta riskli bölgeye girdiğinden beri bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerindedir**.

Bu hafta **22** Bir hafta önce **22** Bir ay önce **29**



RİSKOMETRE

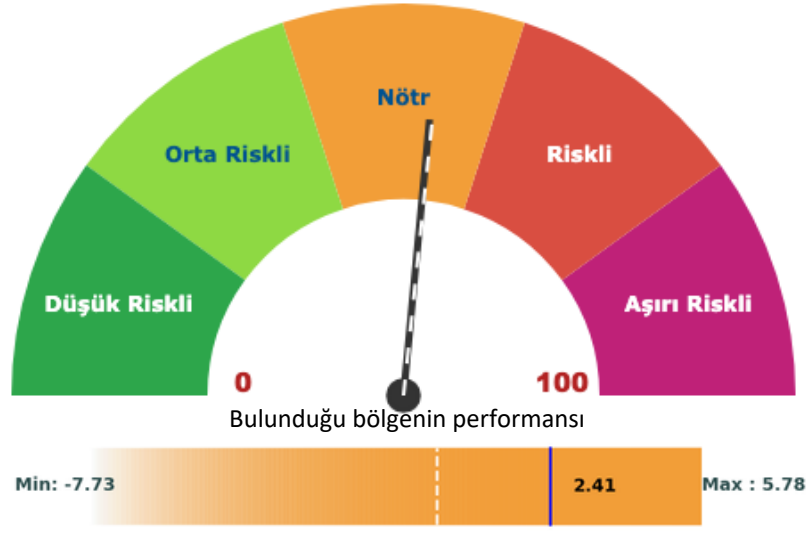
S&P

2 - 8 Eylül 2024

1 aylık dönemde **nötr bölgede** yer alan ABD Hisse Senedi modeli bu hafta stabil seyretmiştir.

Modelin sabit kaldığı 1 haftada endeks **%0.51 değer kaybetmiştir**. S&P Endeksinin performansı, model nötr bölgeye girdiğinden beri bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerindedir**.

Bu hafta **53** Bir hafta önce **53** Bir ay önce **51**

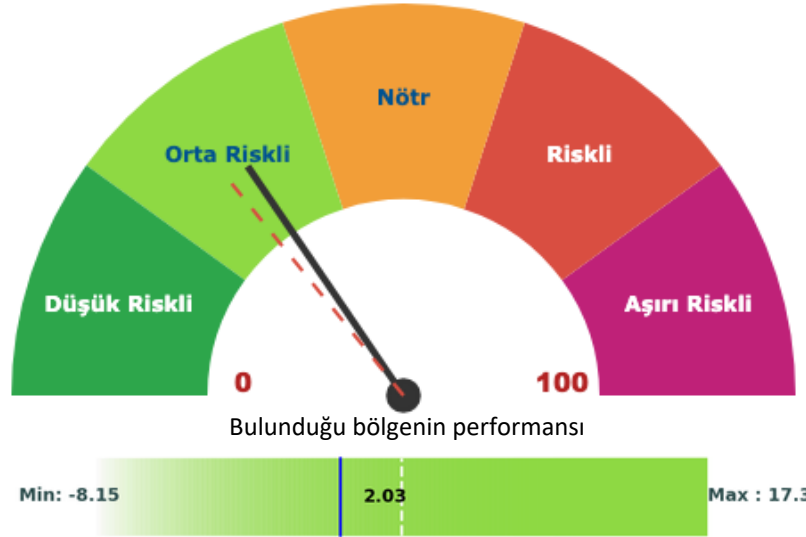


NASDAQ

NASDAQ modeli 1 haftalık ve 1 aylık dönemde **orta riskli bölge** içinde riskli yöne ilerleyişini sürdürmüştür.

NASDAQ Endeksi, modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftada **%2.31 değer kaybetmiştir**. NASDAQ Endeksi performansı, model orta riskli bölgede bulunduğu zamanda **tarihsel ortalamasının altındadır**.

Bu hafta **31** Bir hafta önce **28** Bir ay önce **28**

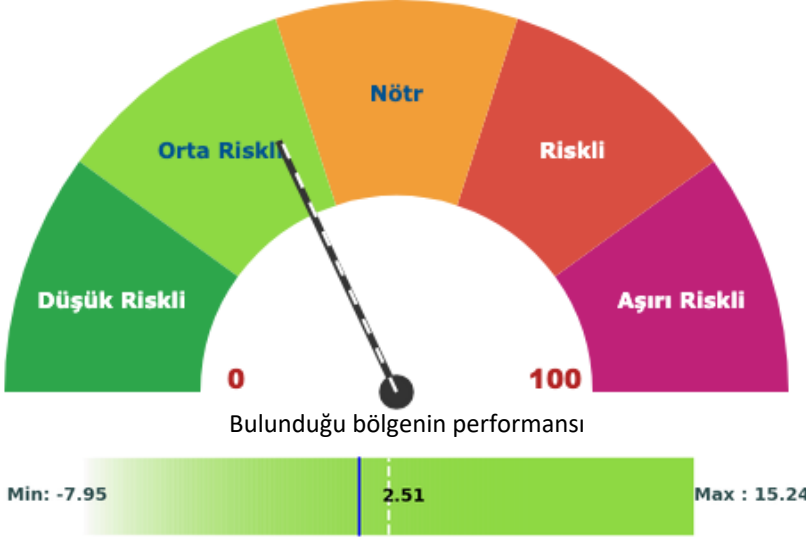


DAX

Almanya Hisse Senedi modeli bu hafta **orta riskli bölge** içinde stabil kalmıştır.

Almanya Hisse Senedi modeli 1 ayda yaklaşık %4.1 getiri sağlarken endeksin performansı, model orta riskli bölgeye girdiğinden beri **ortalamanın altında seyretmektedir**.

Bu hafta **36** Bir hafta önce **36** Bir ay önce **32**



NIKKEI

Japonya Hisse Senedi Modeli 1 ayda **aşırı riskli bölgeden orta riskli bölgeye** dönmüştür

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada Nikkei Endeksi yaklaşık **%0.5 değer kazanmıştır**. Model bu bölgeye girdiğinden beri endeks **performansı bu bölgedeki tarihsel ortalamasının üzerinde seyretmektedir**.

Bu hafta **34** Bir hafta önce **41** Bir ay önce **81**

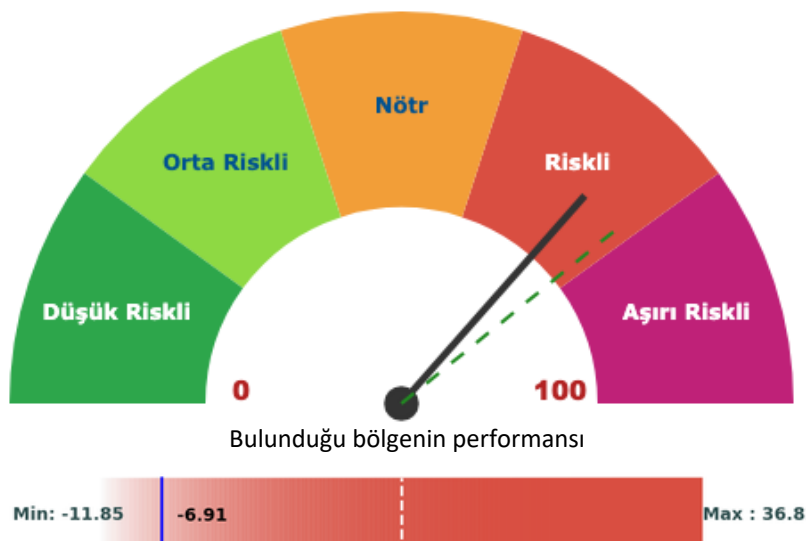


PETROL

Petrol modeli 1 aylık dönemde **riskli bölge** içinde dalgalanmaktadır.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftalık dönemde Petrol yaklaşık **%1.94 getiri sağlamıştır**. Petrol performansı, model riskli bölgeye girdiğinden beri **tarihsel ortalamasının altında bulunmaktadır**.

Bu hafta **73** Bir hafta önce **78** Bir ay önce **71**



RİSKOMETRE

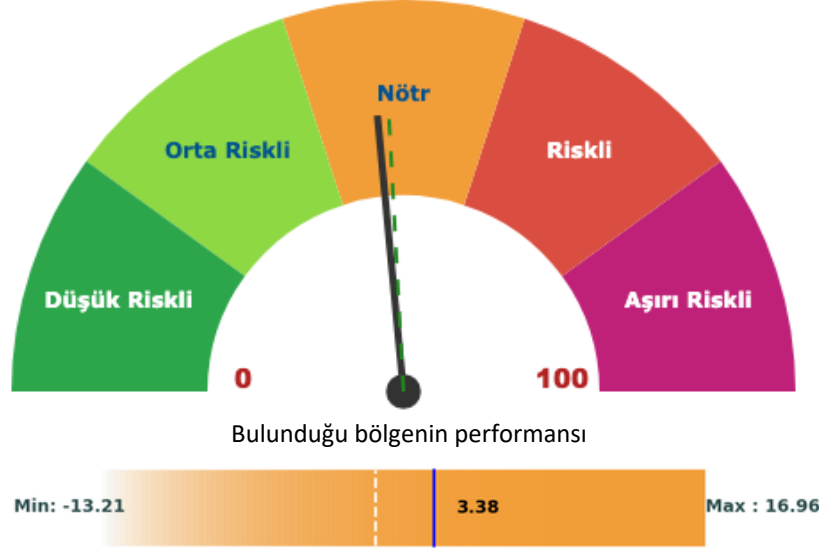
GÜMÜŞ

2 - 8 Eylül 2024

1 aylık dönemde nötr bölge içinde dalgalanan Gümüş modeli bu hafta düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Gümüş, modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda **%3.82 değer kazanmıştır**. Gümüşün getirisi, modelin nötr bölgede bulunduğu sürede **tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır**.

Bu hafta **47** Bir hafta önce **48** Bir ay önce **50**

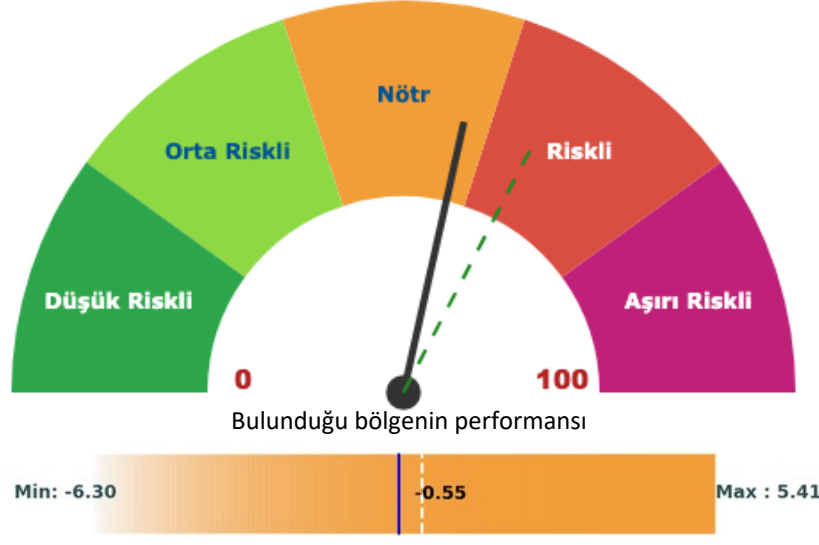


GBPUSD

1 aylık dönemde dalgalı hareket eden GBPUSD modeli bu hafta riskli bölgeden **nötr bölgeye** dönmüştür.

GBPUSD paritesi, modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada **%1 değer kazanmıştır**. GBPUSD paritesi performansı, model nötr bölgeye girdiğinden beri **tarihsel ortalamasının altında seyretmektedir**.

Bu hafta **57** Bir hafta önce **65** Bir ay önce **43**

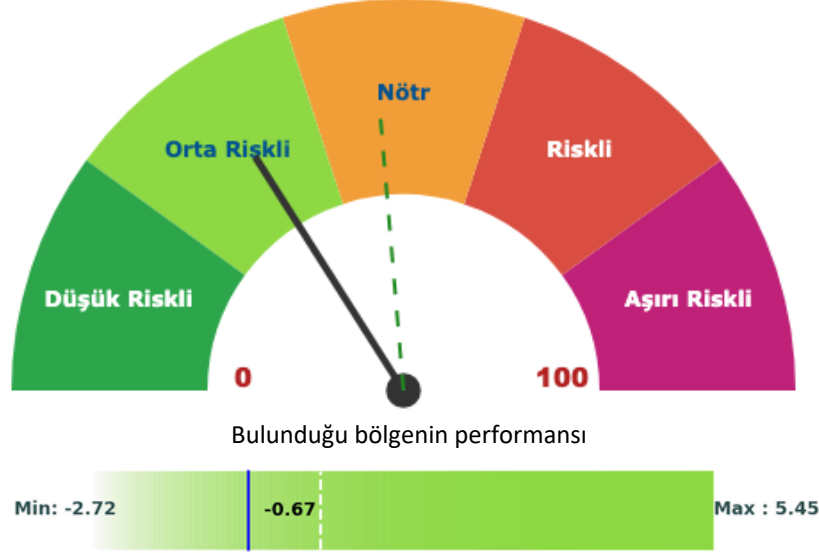


EURUSD

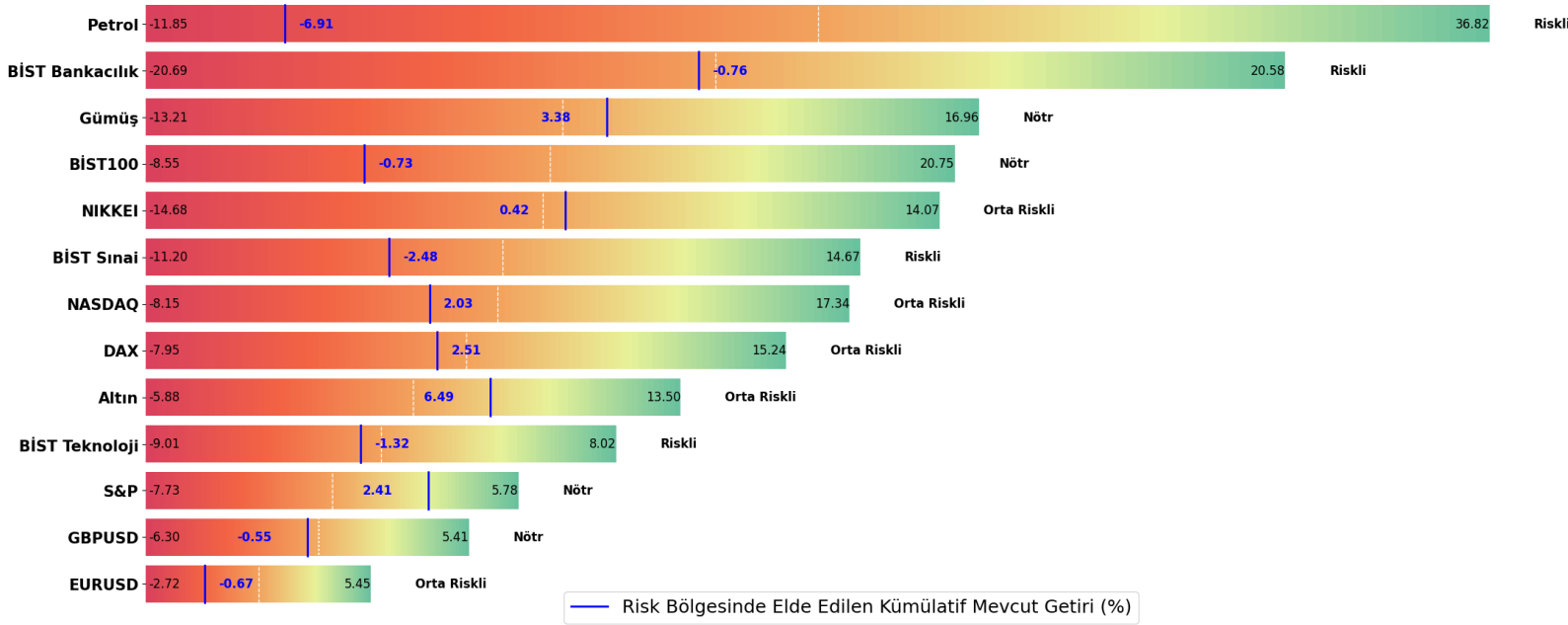
Geçtiğimiz hafta nötr bölgeyi test eden EURUSD modeli bu hafta **orta riskli bölgeye** dönmüştür.

Model 1 ayda düşük riskli yöne ilerlerken EURUSD paritesi yaklaşık **%3.13 getiri** elde etmiştir. EURUSD paritesi performansı, model orta riskli bölgeye girdiğinden beri bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altındadır**.

Bu hafta **32** Bir hafta önce **47** Bir ay önce **34**

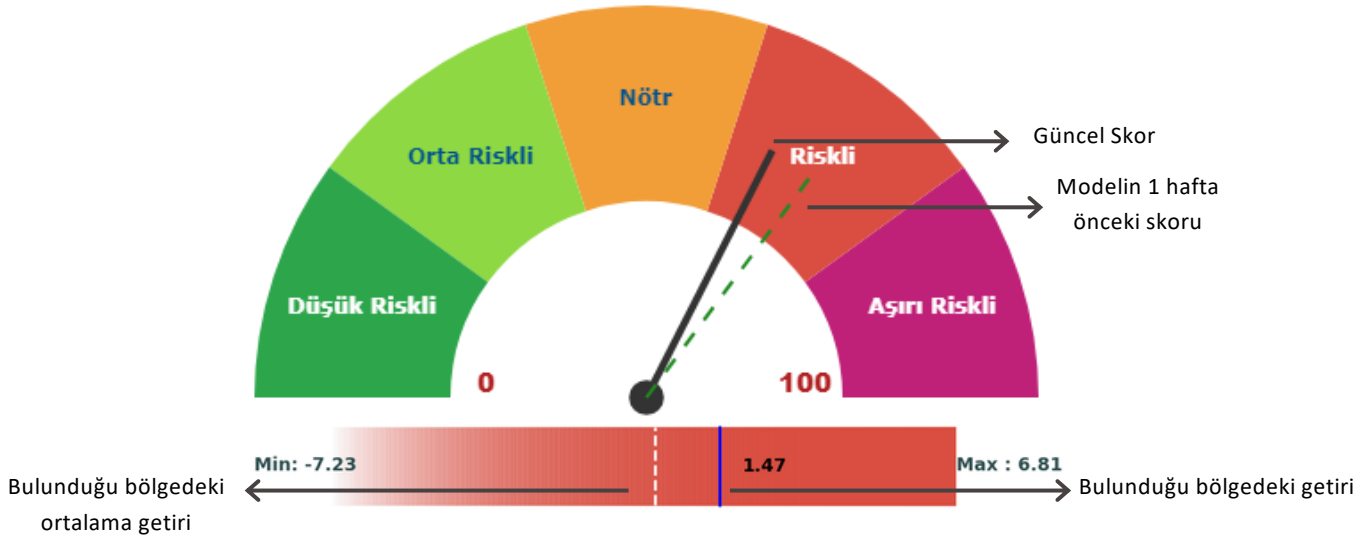


Bulunduğu Bölgeye Göre Getiri Bantları



*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:

arfcap
www.arf.capital

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."