

RİSKOMETRE

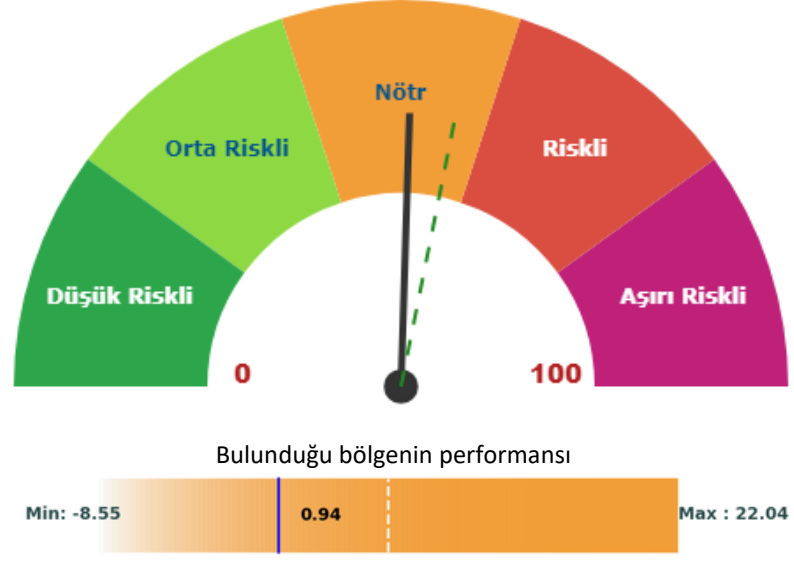
BIST100

19 - 25 Ağustos 2024

BIST100 modeli 1 aylık dönemde **nötr bölge** içinde dalgalı seyrederken bu hafta 1 ay önceki konumuna yaklaşmıştır.

Modelin nötr sinyali verdiği 1 ayda BIST100 endeksi yaklaşık **%9 değer kaybı yaşamıştır**. Model nötr bölgeye girdiğinden beri endeksin getirisi bu bölgedeki tarihi ortalamasının altında bulunmaktadır.

Bu hafta **51** Bir hafta önce **56** Bir ay önce **50**

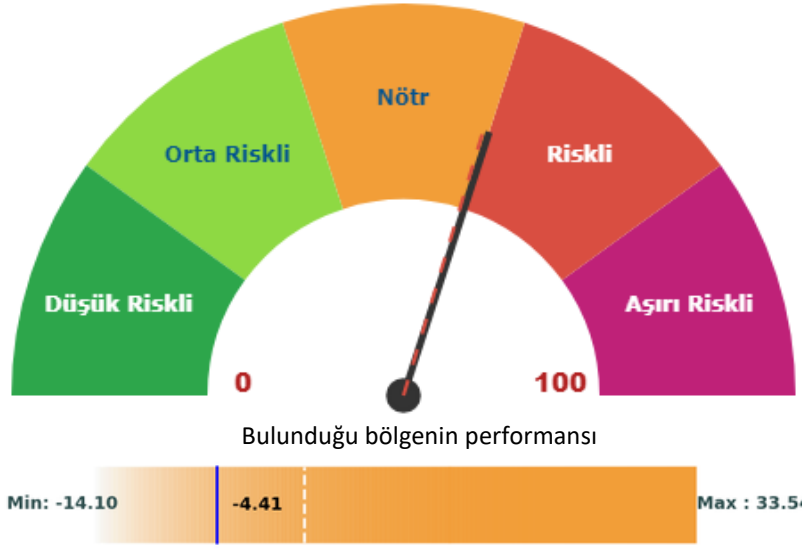


BIST TEKNOLOJİ

BIST Teknoloji modeli 1 aylık dönemde **nötr bölge** içinde riskli yöne ilerleyişini sürdürmüştür.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 ayda BIST Teknoloji Endeksi yaklaşık **%11 değer kaybederken**, model nötr bölgeye girdiğinden beri endeksin performansı tarihsel ortalamasının altında yer almaktadır.

Bu hafta **60** Bir hafta önce **59** Bir ay önce **45**

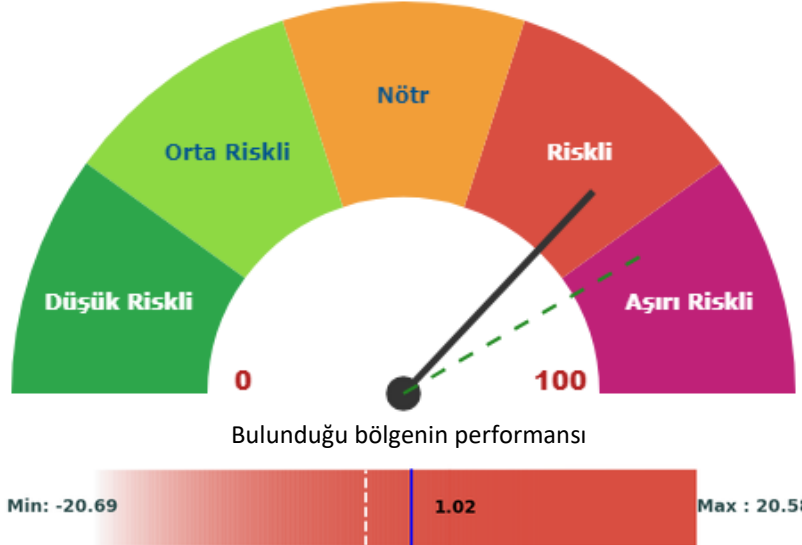


BIST BANKACILIK

1 ayda dalgalı seyreden BIST Bankacılık modeli bu hafta aşırı riskli bölgeden **riskli bölgeye** geçiş yapmıştır.

BIST Bankacılık Endeksi modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada yaklaşık **%3 değer kazanmıştır**. Model riskli bölgeye girdiğinden beri endeksin **getiri performansı tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır**.

Bu hafta **74** Bir hafta önce **83** Bir ay önce **54**

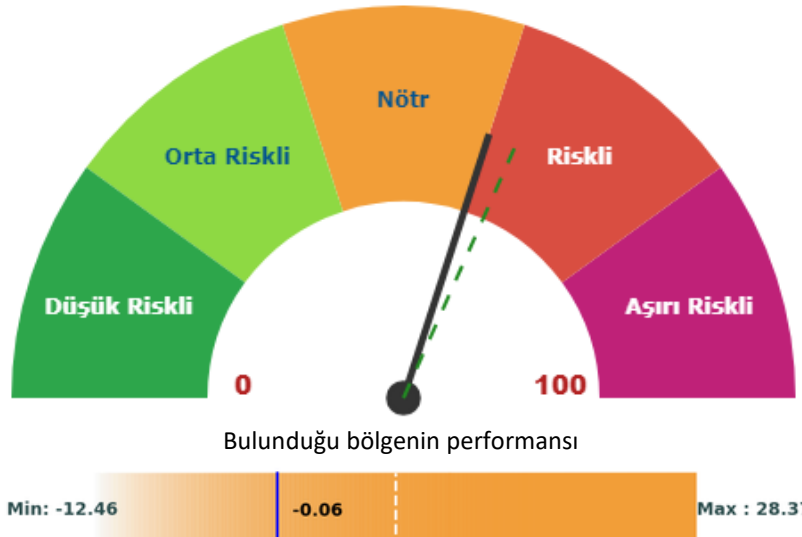


BIST SINAI

BIST Sınai modeli 1 ayda riskli yöne ilerlerken bu hafta **nötr bölge** sınırına dönüş yapmıştır.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 ayda BIST Sınai Endeksi yaklaşık **%8.5 değer kaybetmiştir**. Model riskli bölgeye girdiğinden beri endeksin getirisi tarihsel ortalamasının altında yer almaktadır.

Bu hafta **60** Bir hafta önce **63** Bir ay önce **51**

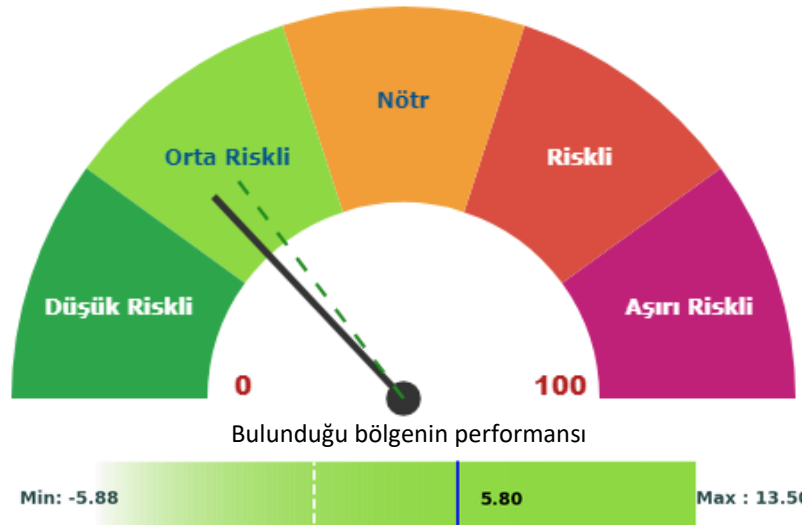


ALTIN

Altın modeli 1 ayda **orta riskli bölge** içinde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada Altın fiyatları yaklaşık **%4.5 değer kazanmıştır**. Model orta riskli bölgeye girdiğinden beri Altının getirisi bu bölgedeki tarihsel ortalamasının üzerinde yer almaktadır.

Bu hafta **26** Bir hafta önce **29** Bir ay önce **36**



RİSKOMETRE

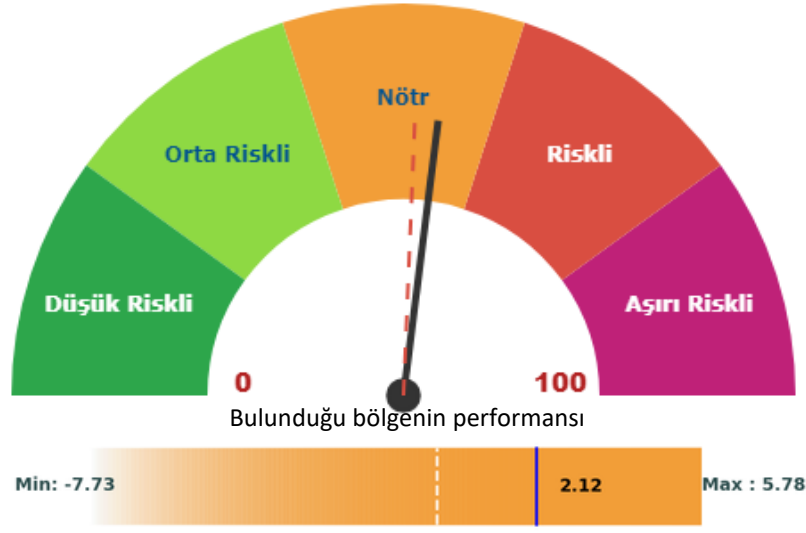
S&P

19 - 25 Ağustos 2024

1 aylık dönemde **nötr bölgede** yer alan ABD Hisse Senedi modeli bu hafta riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin nötr sinyali verdiği 1 ayda S&P Endeksi yaklaşık **%3 değer kazanmıştır**. Model nötr bölgeye girdiğinden beri endeks **getirisi bu bölgedeki tarihsel ortalamasının üzerinde seyretmektedir**.

Bu hafta **54** Bir hafta önce **51** Bir ay önce **53**

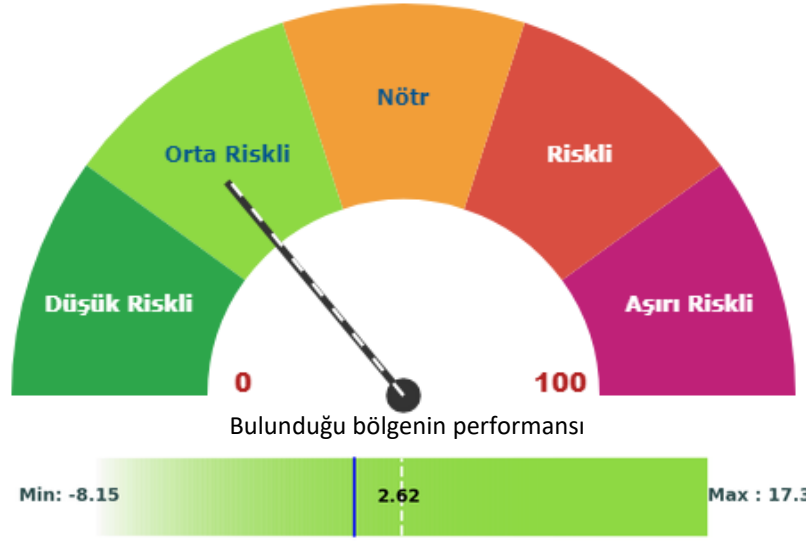


NASDAQ

Ay başında riskli bölgeyi test eden NASDAQ modeli bu hafta **orta riskli bölgede** konumunu koruyarak 1 ay önceki konumuna dönüş yapmıştır.

NASDAQ Endeksi 1 aylık dönemde yaklaşık **%4 değer kazanmıştır**. Model orta riskli bölgeye girdiğinden beri endeksin **getirisi tarihsel ortalamasının altında bulunmaktadır**.

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

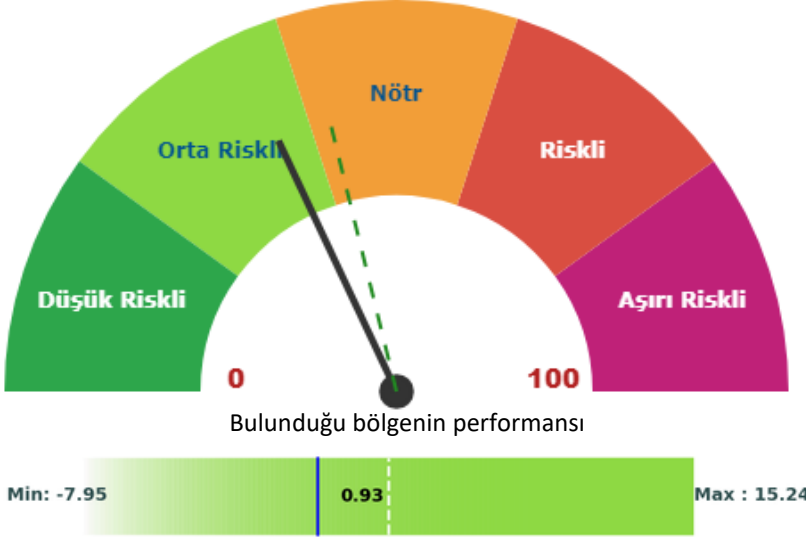


DAX

Geçen hafta nötr bölgeyi test eden Almanya Hisse Senedi modeli bu hafta **orta riskli bölgeye** dönüş yapmıştır.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada DAX Endeksi yaklaşık **%2 değer kazanmıştır**. Model orta riskli bölgeye girdiğinden beri endeksin **getirisi bu bölgedeki ortalamasının biraz altında bulunmaktadır**.

Bu hafta **36** Bir hafta önce **42** Bir ay önce **30**

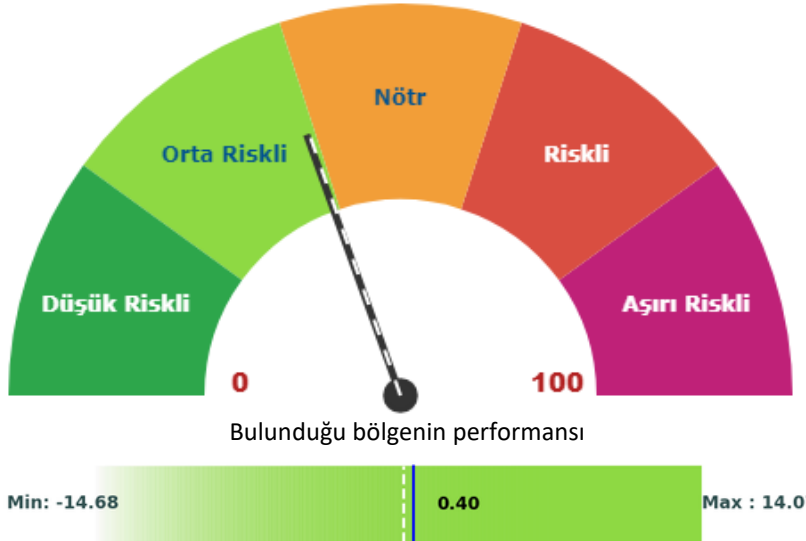


NIKKEI

Japonya Hisse Senedi Modeli 1 ayda riskli bölgeden **orta riskli bölgeye** dönüş yaparken bu hafta stabil seyretmiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda Nikkei Endeksi yaklaşık **%1.5 değer kazanmıştır**. Model bu bölgeye girdiğinden beri endeks **performansı bu bölgedeki tarihsel ortalamasının hafif üzerinde seyretmektedir**.

Bu hafta **39** Bir hafta önce **39** Bir ay önce **67**

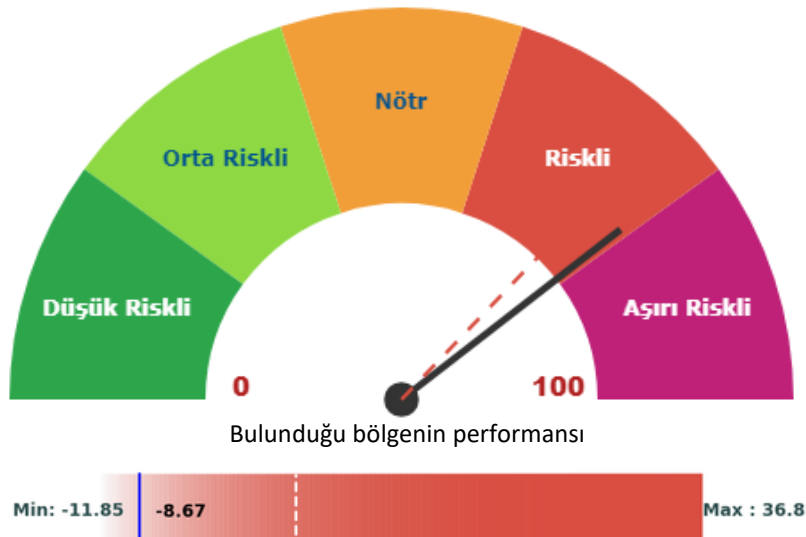


PETROL

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

Modelin riskli sinyali verdiği 1 ayda Petrol fiyatları yaklaşık **%5 değer kaybetmiştir**. Model riskli bölgeye girdiğinden beri petrol fiyatlarının **getirisi tarihsel ortalamasının altında yer almaktadır**.

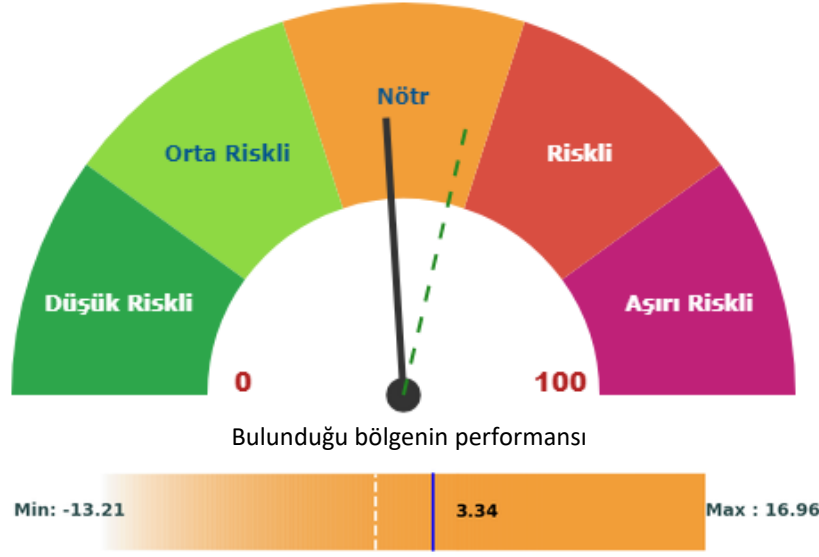
Bu hafta **79** Bir hafta önce **74** Bir ay önce **66**



Gümüş modeli dalgalı seyrettiği 1 ayda **nötr bölge** içinde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda Gümüş fiyatları yaklaşık **%5 değer kazanırken** model nötr bölgeye girdiğinden beri gümüşün performansı **bu bölgedeki tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır.**

Bu hafta **48** Bir hafta önce **57** Bir ay önce **50**

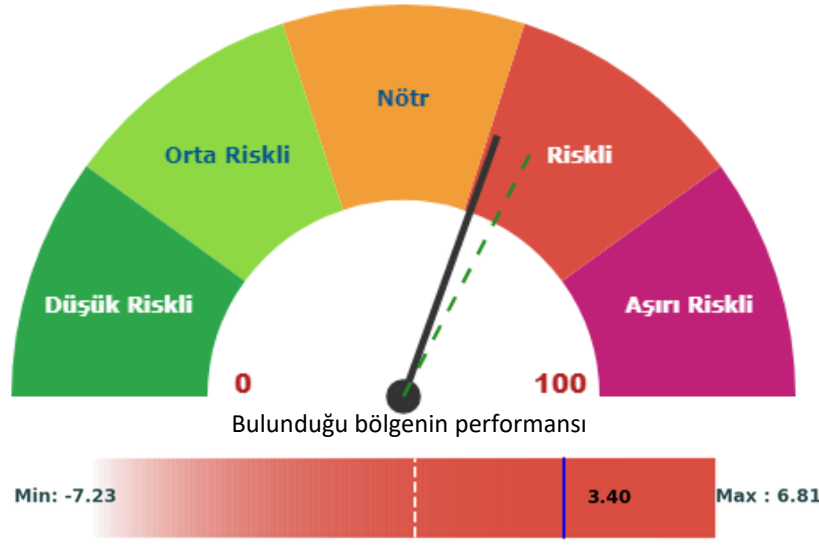


GBPUSD

GBPUSD modeli 1 aylık dönemde riskli yöne ilerlerken bu hafta **riskli bölge** içinde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin nötr bölge sınırına yaklaştığı 1 haftada GBPUSD paritesi yaklaşık **%1.5 değer kazanmıştır.** Model riskli bölgeye girdiğinden beri parite **getirisi bu bölge içinde sağladığı ortalama getirinin üzerinde yer almaktadır.**

Bu hafta **61** Bir hafta önce **65** Bir ay önce **39**



EURUSD

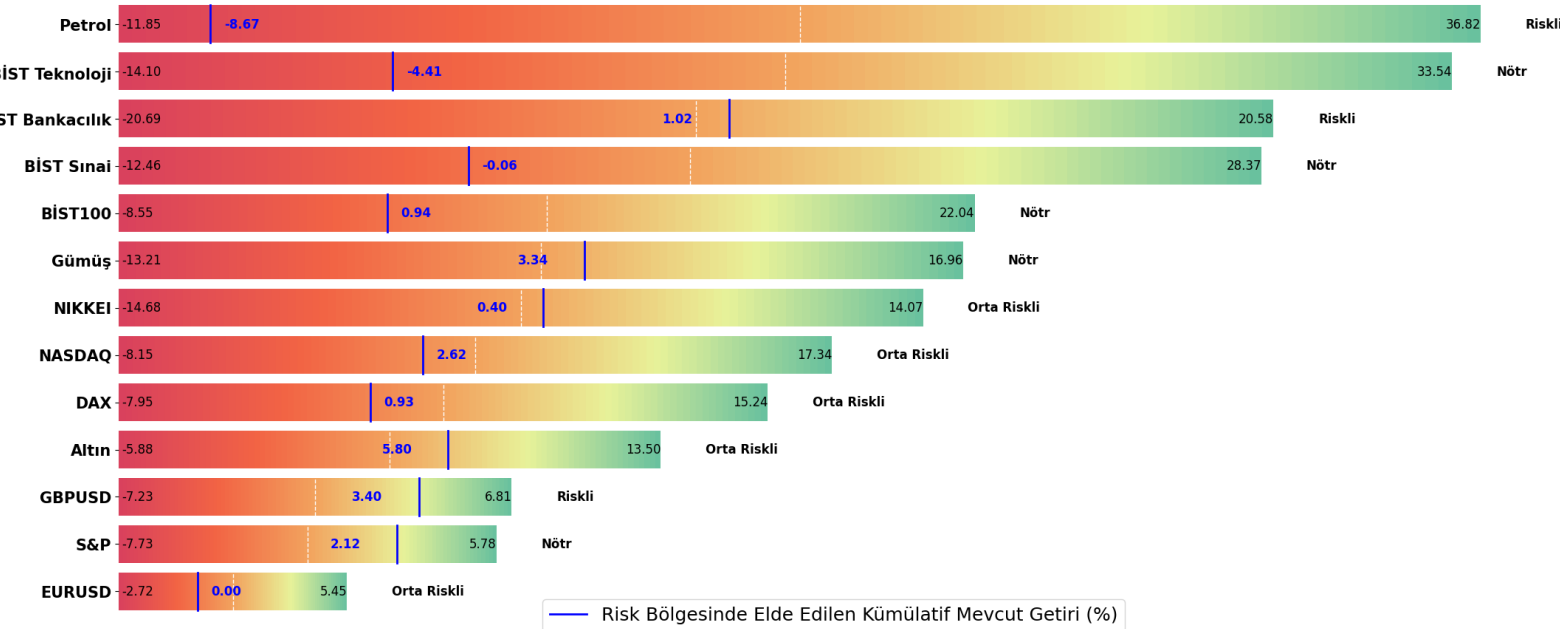
Geçtiğimiz hafta nötr bölgeyi test eden EURUSD modeli bu hafta **orta riskli bölge** sınırına dönüş yapmıştır.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada EURUSD paritesi yaklaşık **%1 değer kazanmıştır.** Model orta riskli bölgeye girdiğinden beri parite **getirisi tarihsel ortalamasının yakınında bulunmaktadır.**

Bu hafta **40** Bir hafta önce **59** Bir ay önce **35**

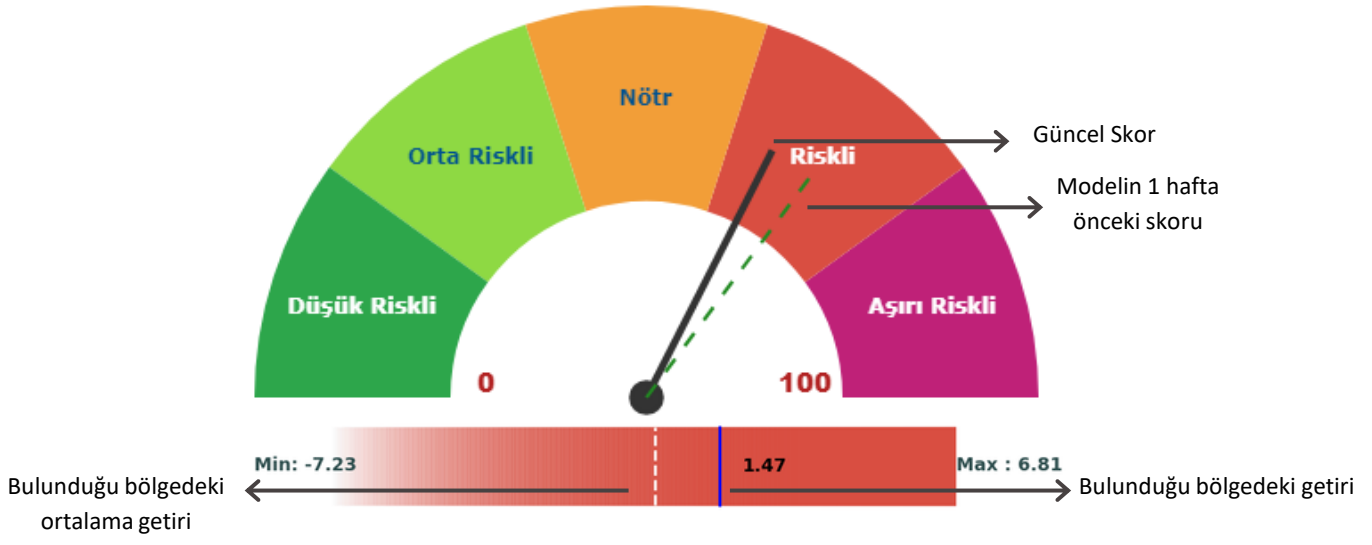


Bulduğu Bölgeye Göre Getiri Bantları



*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."