

RİSKOMETRE

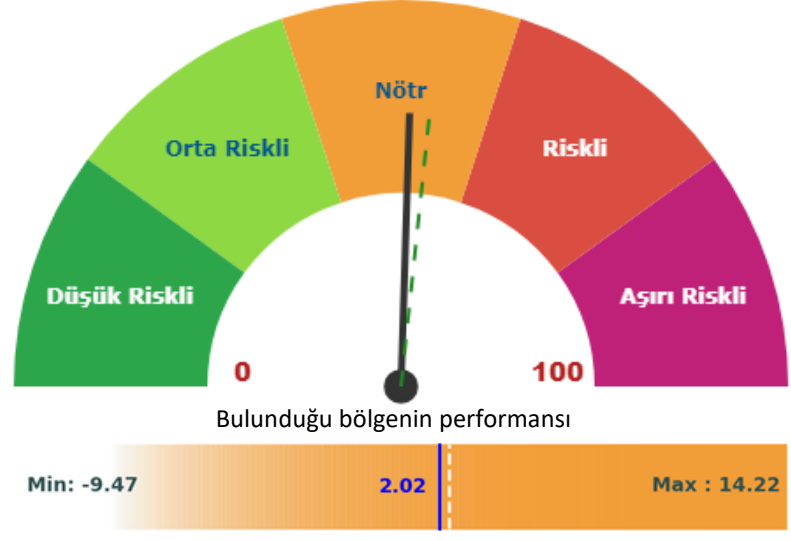
BIST100

8 - 14 Temmuz 2024

BIST100 modeli 1 aylık ve 1 haftalık dönemde **nötr bölge** içinde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda BIST100 endeksi yaklaşık **%7.5 değer kazanmıştır**. Model nötr bölgeye girdiğinden beri endeksin **getirisi bu bölgedeki ortalama performansa yakındır**.

Bu hafta **51** Bir hafta önce **53** Bir ay önce **55**

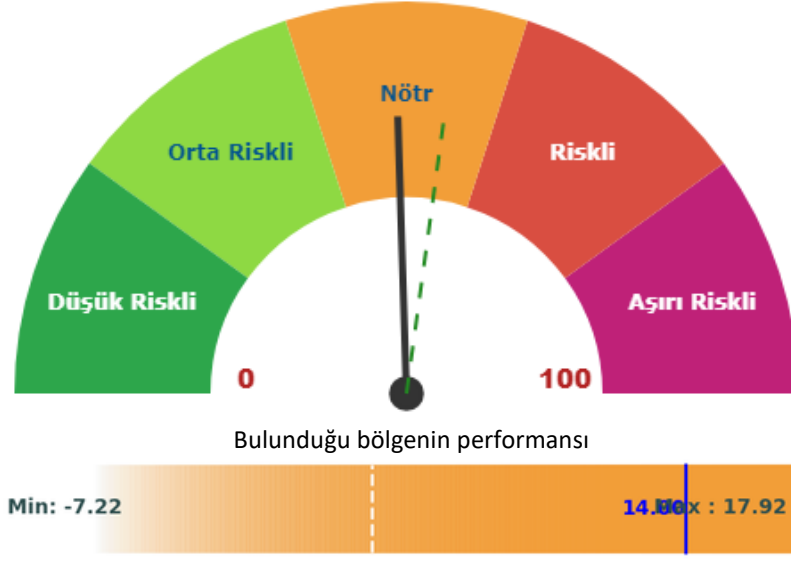


BIST30

BIST30 modeli bu ay **nötr bölge** içinde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin nötr bölgede yer aldığı 1 ayda BIST30 Endeksi yaklaşık **%8 değer kazanırken**, model nötr bölgeye girdiğinden beri endeksin **performansı tarihsel maksimum değerine yakın seyretmektedir**.

Bu hafta **49** Bir hafta önce **54** Bir ay önce **57**

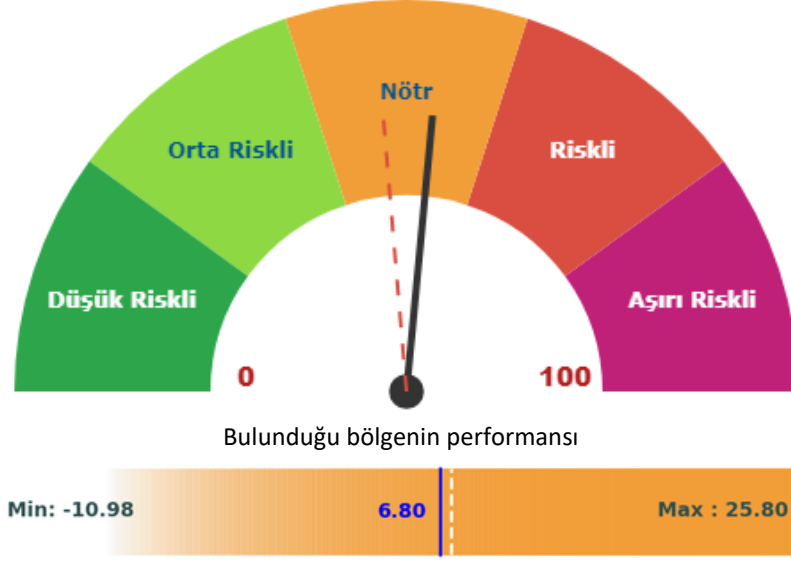


BIST BANKACILIK

BIST Bankacılık modeli 1 aylık ve 1 haftalık dönemde **nötr bölge** içinde riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin nötr sinyal verdiği 1 ayda BIST Bankacılık Endeksi yaklaşık **%10 değer kazanmıştır**. Model nötr bölgeye girdiğinden beri endeksin **getiri performansı tarihsel ortalamasının yakınlarında bulunmaktadır**.

Bu hafta **53** Bir hafta önce **47** Bir ay önce **45**

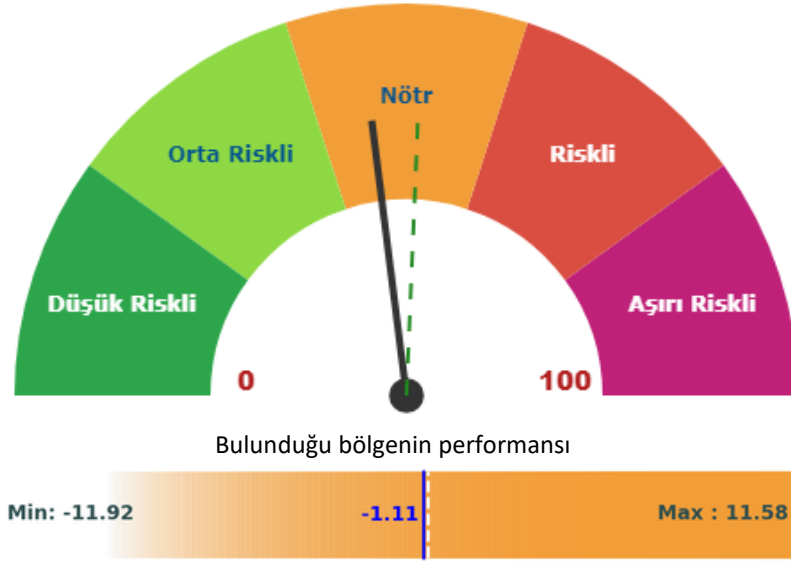


BIST SINAI

BIST Sınai modeli 1 aylık ve 1 haftalık dönemde bulunduğu **nötr bölgede** düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda BIST Sınai Endeksi yaklaşık **%5.5 değer kazanmıştır**. Model nötr bölgeye girdiğinden beri endeksin **getirisi tarihsel ortalamasına çok yakın seviyede bulunmaktadır**.

Bu hafta **46** Bir hafta önce **51** Bir ay önce **48**

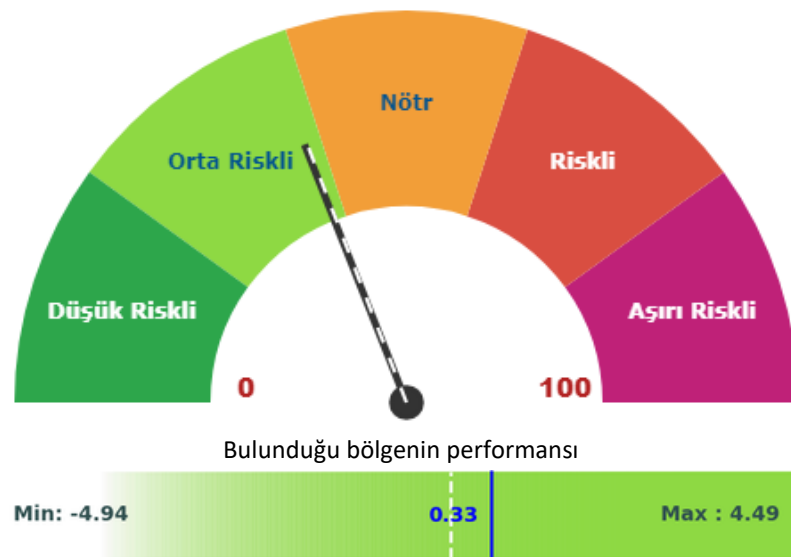


ALTIN

Altın modeli 1 aylık dönemde **orta riskli bölge** içinde yer alırken bu hafta konumunu korumuştur.

Modelin stabil seyrettiği 1 haftada Altın fiyatları yaklaşık **%2 değer kazanmıştır**. Model orta riskli bölgeye girdiğinden beri Altının **getirisi bu bölgedeki tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır**.

Bu hafta **38** Bir hafta önce **38** Bir ay önce **32**



RİSKOMETRE

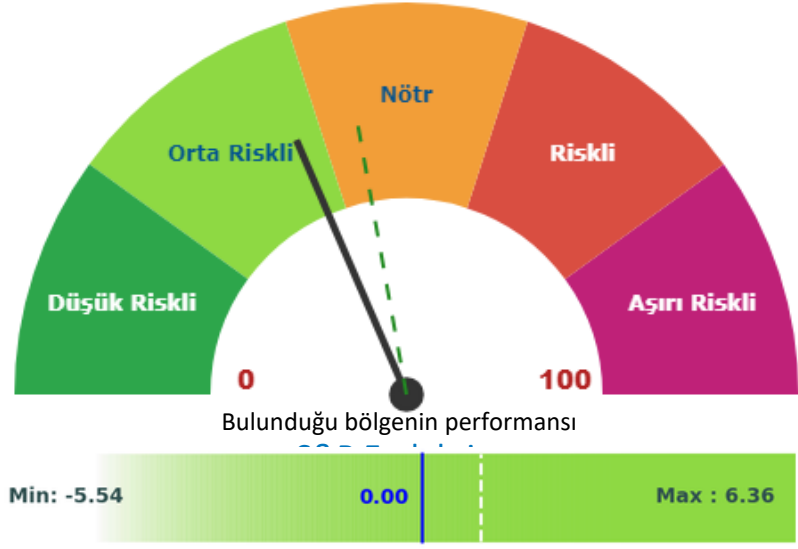
S&P

8 - 14 Temmuz 2024

ABD Hisse Senedi modeli bu hafta nötr bölgeden **orta riskli bölgeye** dönüş yapmıştır.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada S&P Endeksi **yaklaşık %1.5 getiri sağlamıştır**. Model orta riskli bölgeye girdiğinden beri endeks **getirisi bu bölgedeki tarihsel performansının altında bulunmaktadır**.

Bu hafta **37** Bir hafta önce **44** Bir ay önce **34**

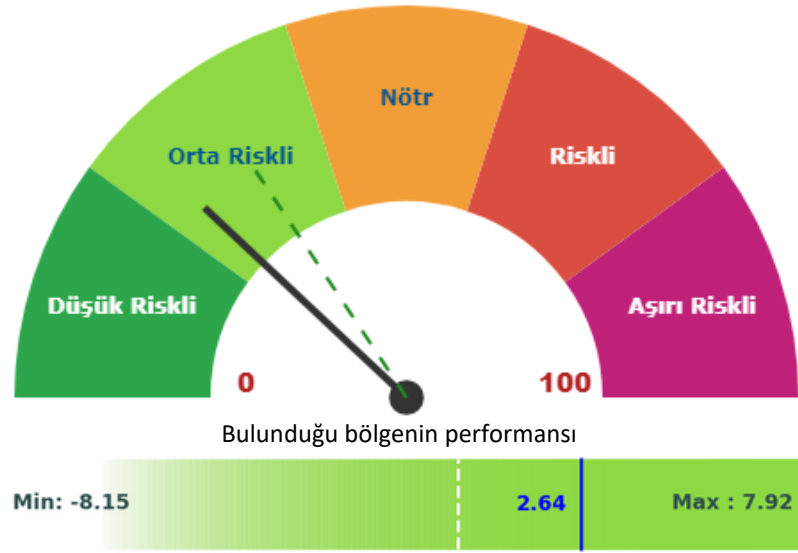


NASDAQ

NASDAQ modeli geçen hafta geçiş yaptığı **orta riskli** bölge içinde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada NASDAQ Endeksi **yaklaşık %2.5 getiri sağlamıştır**. Model orta riskli bölgeye girdiğinden beri endeksin **getirisi bu bölgedeki tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır**.

Bu hafta **24** Bir hafta önce **31** Bir ay önce **18**

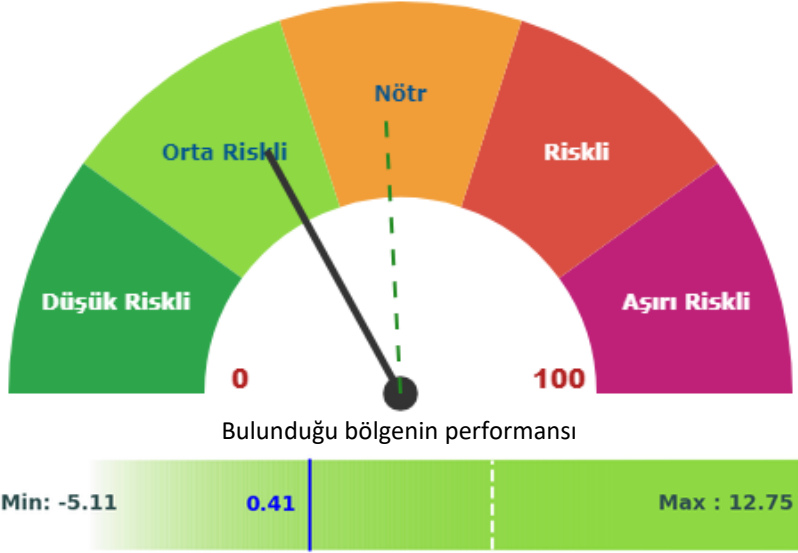


DAX

Almanya Hisse Senedi modeli bu hafta nötr bölgeden **orta riskli bölgeye** geçiş 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 altında seyretmektedir**.

Bu hafta **34** Bir hafta önce **48** Bir ay önce **26**

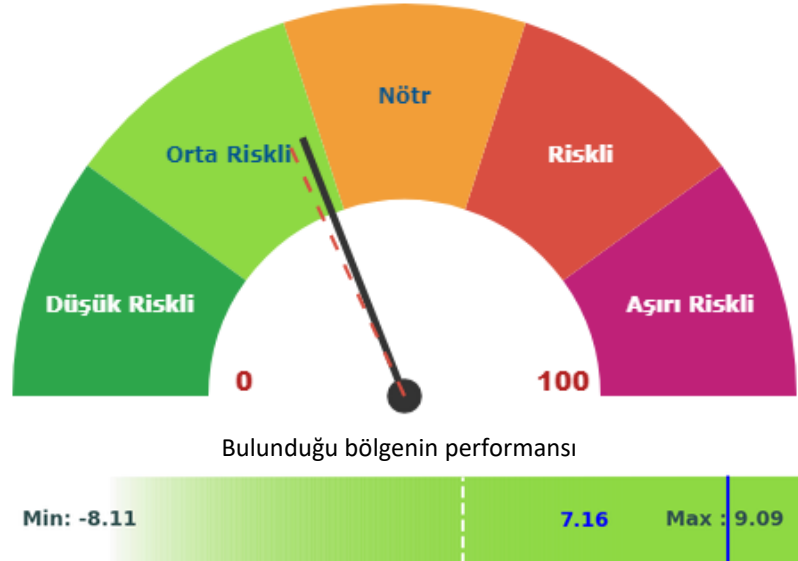


NIKKEI

Japonya Hisse Senedi Modeli bu hafta **orta riskli bölge** içinde riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin orta risk sinyali verdiği 1 aylık dönemde Nikkei Endeksi **yaklaşık %6 getiri sağlamıştır**. Model orta riskli bölgeye girdiğinden beri **performansı tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır**.

Bu hafta **38** Bir hafta önce **36** Bir ay önce **38**

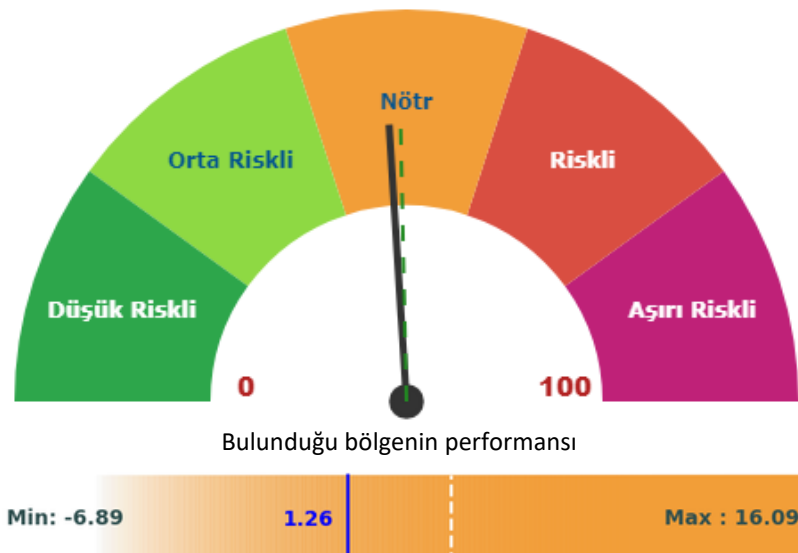


PETROL

Petrol modeli **nötr bölgede** bulunmaktadır. 1 aylık dönemde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda Petrol fiyatlarında yaklaşık **%10 getiri** gözlenirken model nötr bölgeye girdiğinden beri petrol fiyatlarının **getirisi tarihsel ortalamasının altında bulunmaktadır**.

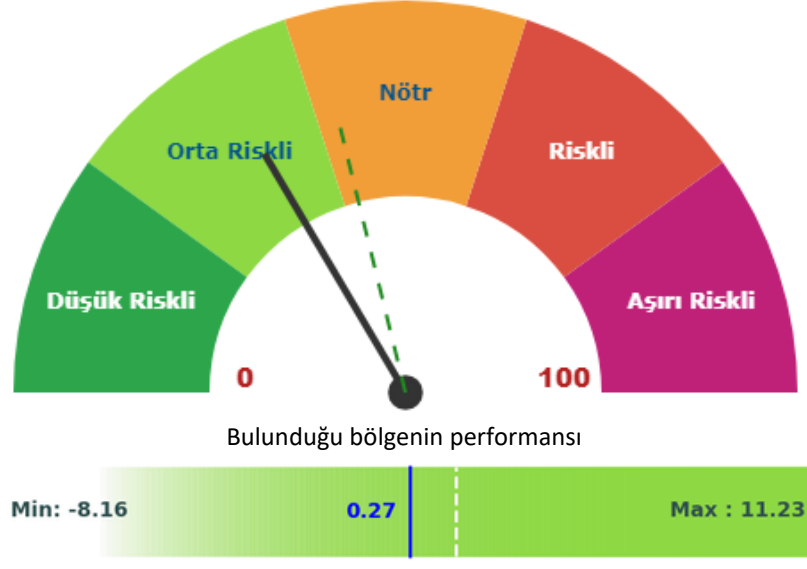
Bu hafta **48** Bir hafta önce **49** Bir ay önce **61**



Gümüş modeli bu hafta nötr bölgeden **orta riskli bölgeye** dönüş yapmıştır.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada gümüş fiyatları yaklaşık %5 değer kazanmıştır, model nötr bölgeye girdiğinden beri gümüşün performansı tarihsel ortalamasının altında bulunmaktadır.

Bu hafta **33** Bir hafta önce **42** Bir ay önce **24**

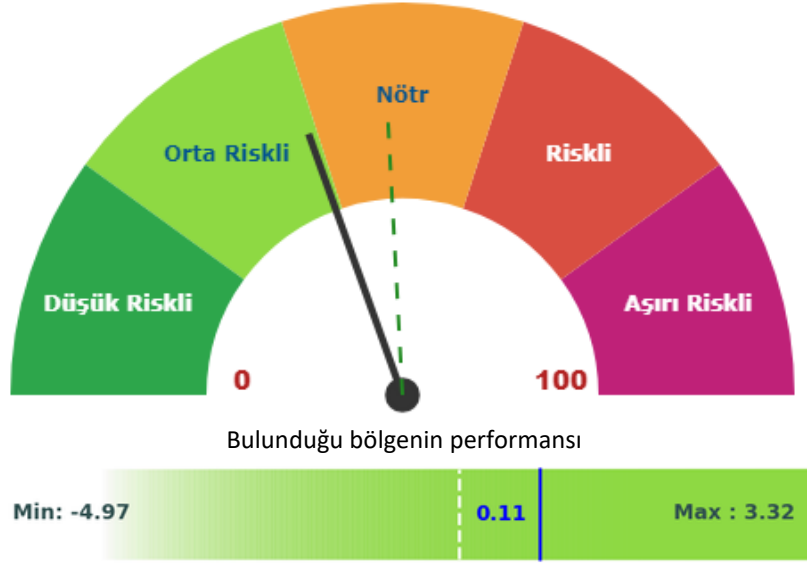


GBPUSD

GBPUSD modeli bu hafta nötr bölgeden **orta riskli bölgeye** geçiş yapmıştır.

Modelin nötr risk sinyali verdiği 1 haftada GBPUSD paritesi yaklaşık %1 değer kazanmış, model orta riskli bölgeye girdiğinden beri parite getirisi bu bölge içinde sağladığı ortalama getirinin üzerinde bulunmaktadır.

Bu hafta **39** Bir hafta önce **48** Bir ay önce **61**

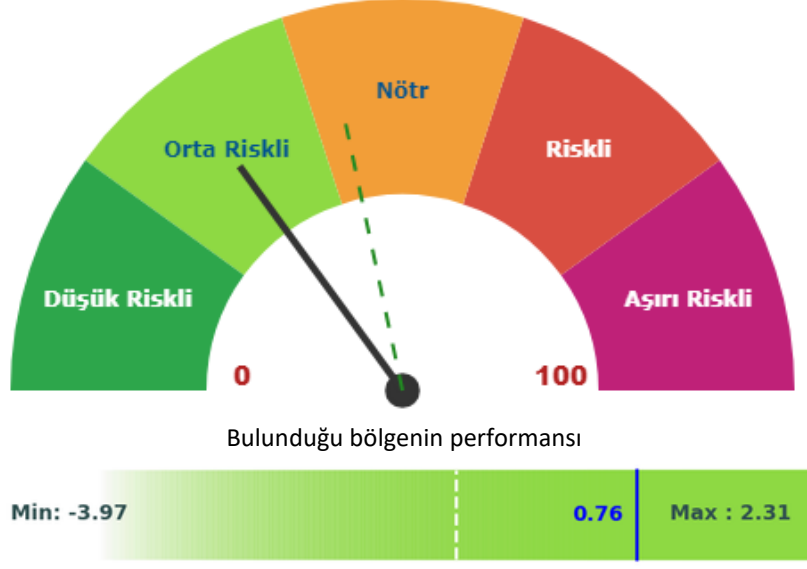


EURUSD

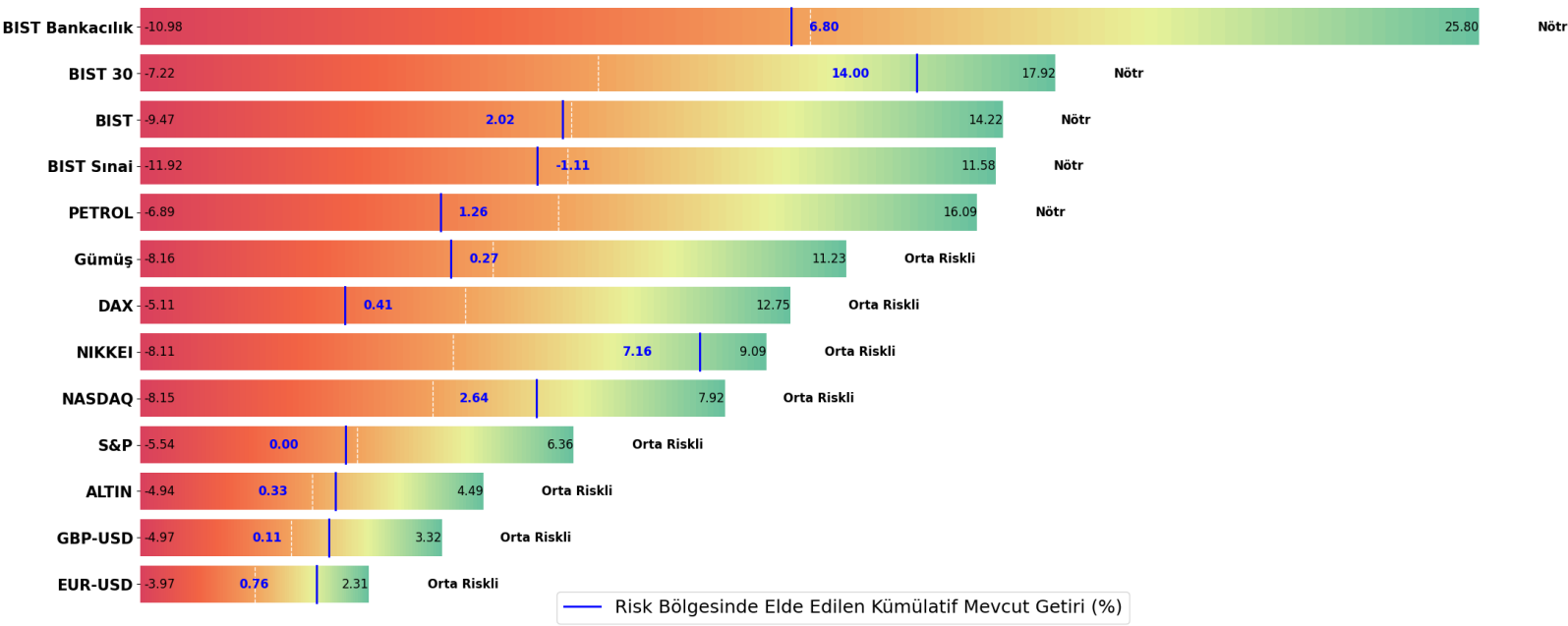
EURUSD modeli bu hafta nötr bölgeden **orta riskli bölgeye** geçmiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada EURUSD paritesi yaklaşık %1 değer kazanırken, model bu bölgeye girdiğinden beri parite getirisi bu bölgedeki tarihsel ortalamasının üzerinde yer almaktadır.

Bu hafta **30** Bir hafta önce **43** Bir ay önce **26**

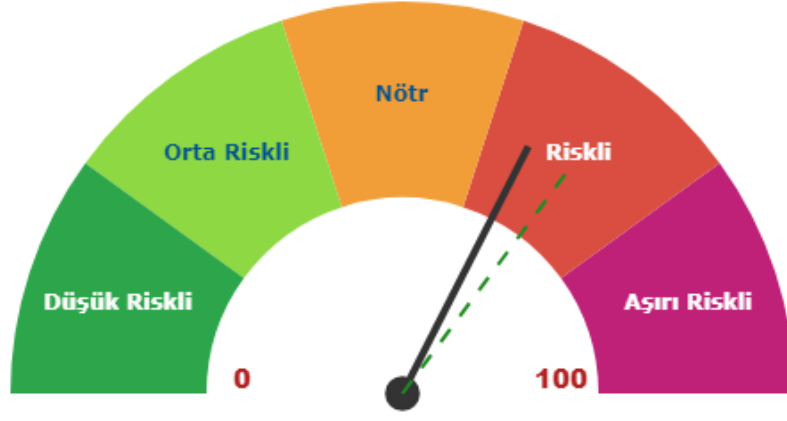


Bulduğu Bölgeye Göre Getiri Bantları



*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:

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.”