

RİSKOMETRE

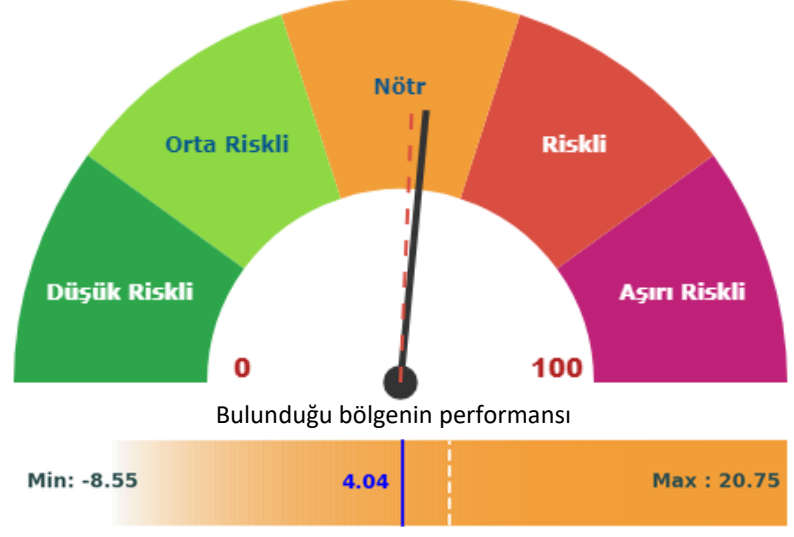
BIST100

29 Temmuz - 4 Temmuz 2024

BIST100 Modeli 1 aylık dönemde düşük riskli yöne ilerleyerek riskli bölgeden **nötr bölgeye** geçiş yapmıştır.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda BIST100 endeksi yaklaşık **%2.5 değer kazanmıştır**. Model nötr bölgeye girdiğinden beri endeksin **getirisi bu bölgedeki ortalamasının altında bulunmaktadır**.

Bu hafta **53** Bir hafta önce **51** Bir ay önce **64**

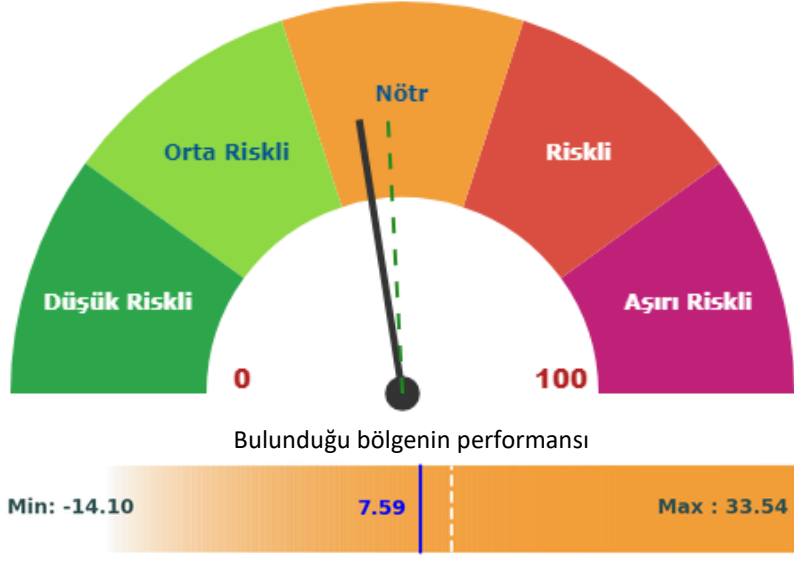


BIST TEKNOLOJİ

BIST Teknoloji modeli 1 ayda riskli bölgeden, **nötr bölgeye** geçiş yapmıştır.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda BIST Teknoloji Endeksi yaklaşık **%6.5 değer kazanırken**, model nötr bölgeye girdiğinden beri endeksin performansı **tarihsel ortalamasının altında bulunmaktadır**.

Bu hafta **45** Bir hafta önce **48** Bir ay önce **63**

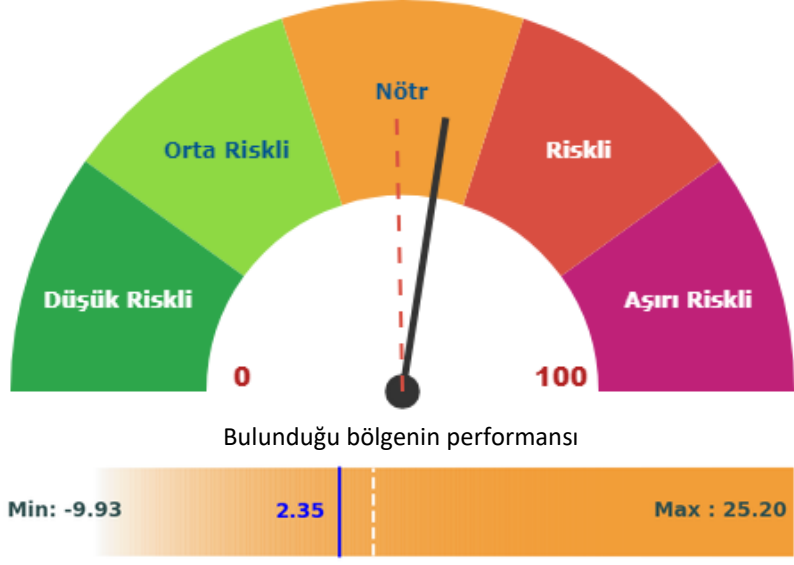


BIST BANKACILIK

BIST Bankacılık modeli bu hafta **nötr bölge** içinde riskli yöne ilerleyerek 1 ay önceki konumuna dönüş yapmıştır.

BIST Bankacılık Endeksi modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftada yaklaşık **%6.5 değer kaybetmiştir**. Model nötr bölgeye girdiğinden beri endeksin **getiri performansı tarihsel ortalamasının altında bulunmaktadır**.

Bu hafta **55** Bir hafta önce **49** Bir ay önce **55**

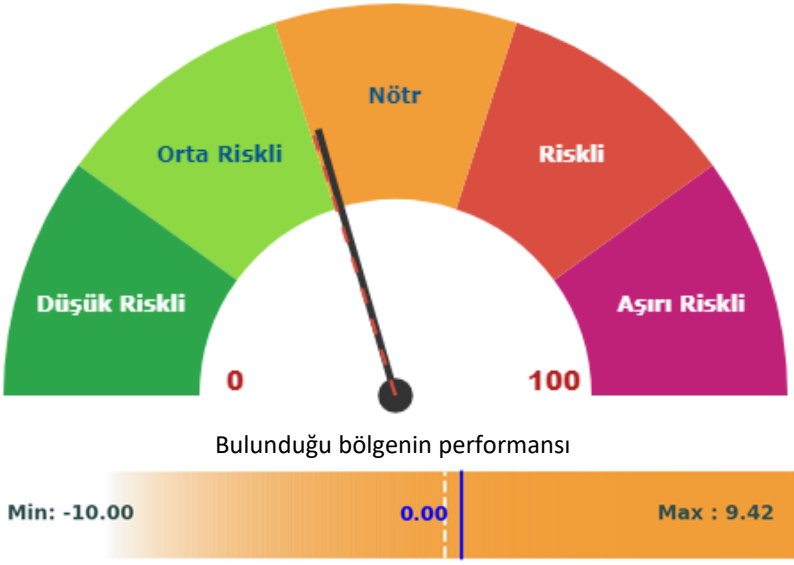


BIST SINAI

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

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda BIST Sınai Endeksi **%3 değer kazanmıştır**. Model nötr bölgeye girdiğinden beri endeksin **getirisi tarihsel ortalaması yakınlarında bulunmaktadır**.

Bu hafta **41** Bir hafta önce **40** Bir ay önce **50**

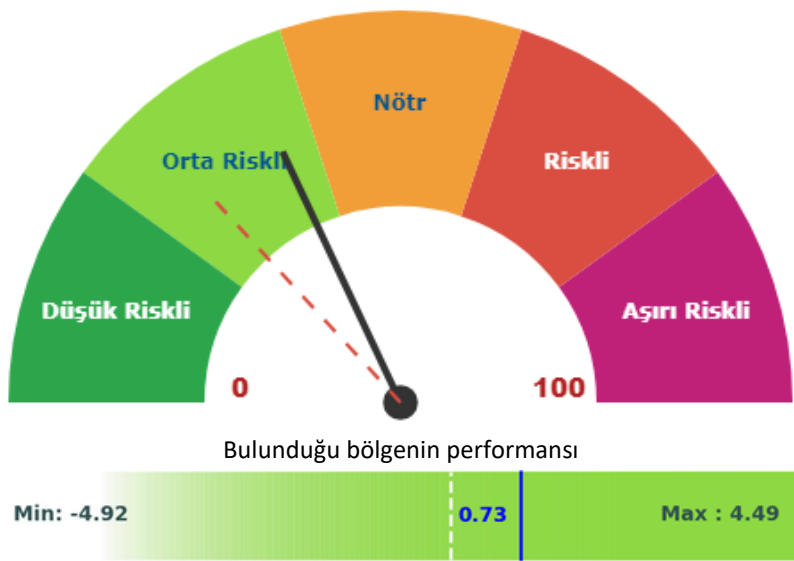


ALTIN

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

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda Altın fiyatları yaklaşık **%1.5 değer kazanmıştır**. Model orta riskli bölgeye girdiğinden beri Altının **getirisi bu bölgedeki tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır**.

Bu hafta **36** Bir hafta önce **26** Bir ay önce **38**



RİSKOMETRE

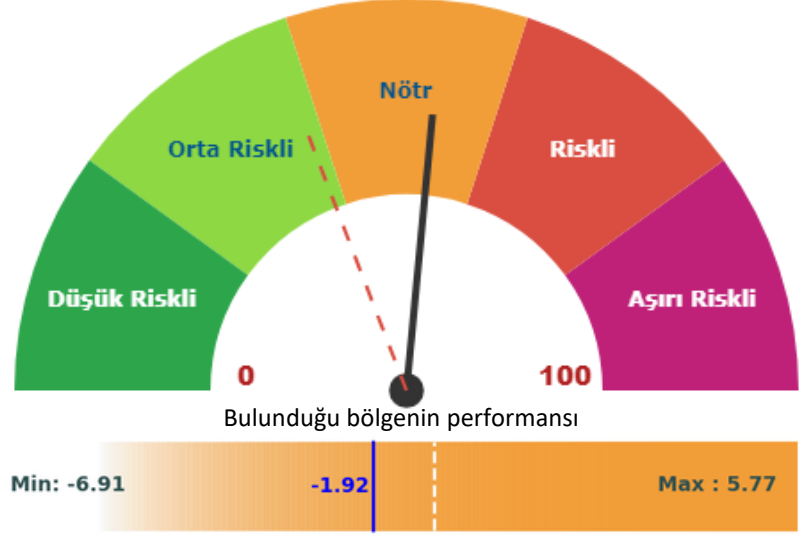
S&P

29 Temmuz - 4 Temmuz 2024

ABD Hisse Senedi modeli bu hafta riskli yöne ilerleyerek **nötr bölgeye** dönüş yapmıştır.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftada S&P Endeksi **yaklaşık %2.5 değer kaybetmiştir**. Model nötr bölgeye girdiğinden beri endeks **getirisi bu bölgedeki tarihsel ortalamasının altında bulunmaktadır**.

Bu hafta **53** Bir hafta önce **38** Bir ay önce **45**

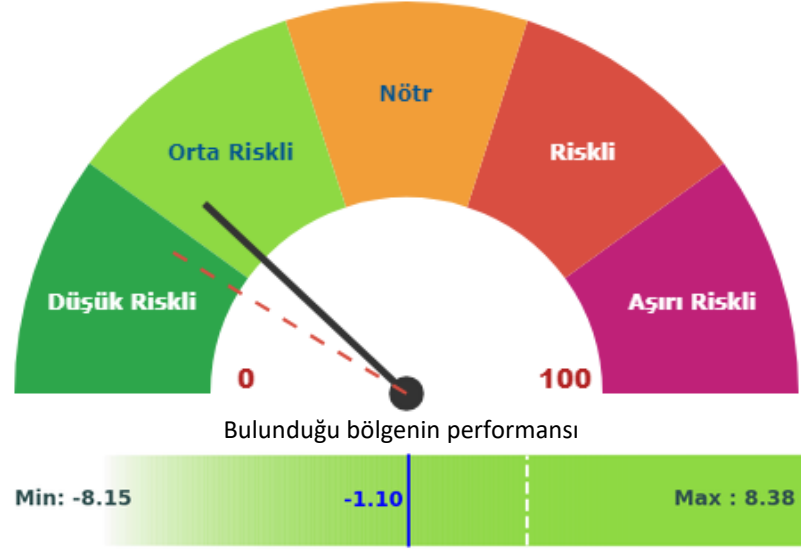


NASDAQ

NASDAQ modeli bu hafta düşük riskli bölgeden **orta riskli bölgeye** dönüş yapmıştır.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftada NASDAQ Endeksi **yaklaşık %4.5 değer kaybetmiştir**. Model orta riskli bölgeye girdiğinden beri endeksin **getirisi bu bölgedeki tarihsel ortalamasının altında bulunmaktadır**.

Bu hafta **24** Bir hafta önce **17** Bir ay önce **31**

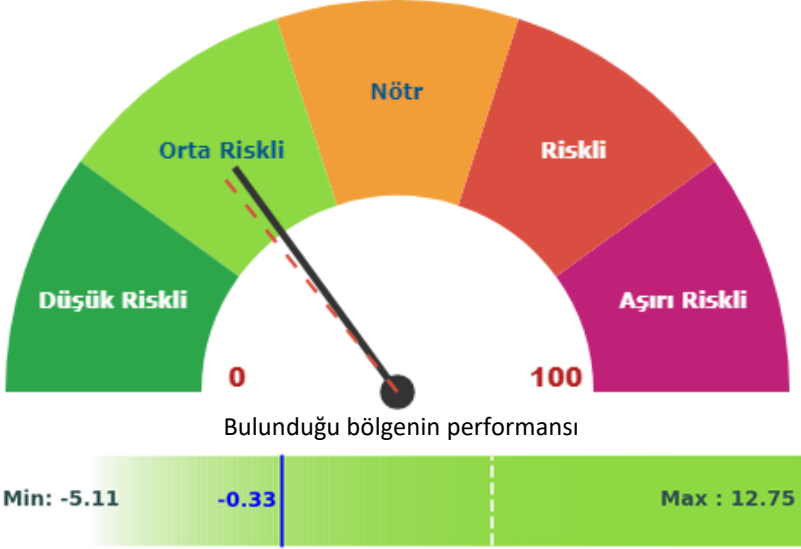


DAX

Almanya Hisse Senedi modeli 1 aylık dönemde düşük riskli yöne ilerleyerek nötr bölgeden **orta riskli bölgeye** geçiş yapmıştır.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda DAX Endeksi **yaklaşık %0.5 değer kazanmıştır**. Model orta riskli bölgeye girdiğinden beri endeksin **getirisi bu bölgedeki ortalamasının altında seyretmektedir**.

Bu hafta **30** Bir hafta önce **28** Bir ay önce **48**



NIKKEI

Japonya Hisse Senedi Modeli 1 ayda riskli yöne ilerleyerek orta riskli bölgeden **nötr bölgeye** geçiş yapmıştır.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftada Nikkei Endeksi **yaklaşık %6 değer kaybetmiştir**. Model nötr bölgeye girdiğinden beri endeks **performansı tarihsel minimum değerinde bulunmaktadır**.

Bu hafta **58** Bir hafta önce **46** Bir ay önce **36**

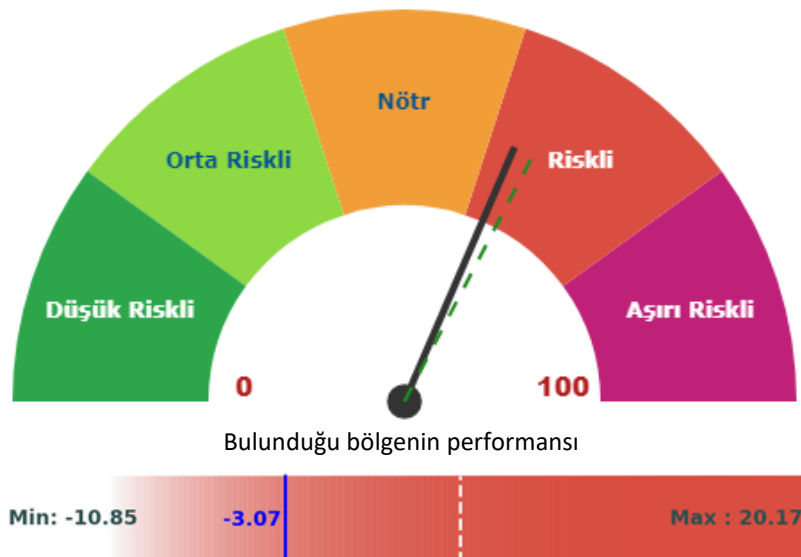


PETROL

1 aylık dönemde riskli yöne ilerleyen Petrol modeli bu hafta **riskli bölge** içinde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 ayda Petrol fiyatları yaklaşık **%5 değer kaybederken**, model riskli bölgeye girdiğinden beri petrol fiyatlarının **getirisi tarihsel ortalamasının altında bulunmaktadır**.

Bu hafta **63** Bir hafta önce **65** Bir ay önce **51**



RİSKOMETRE

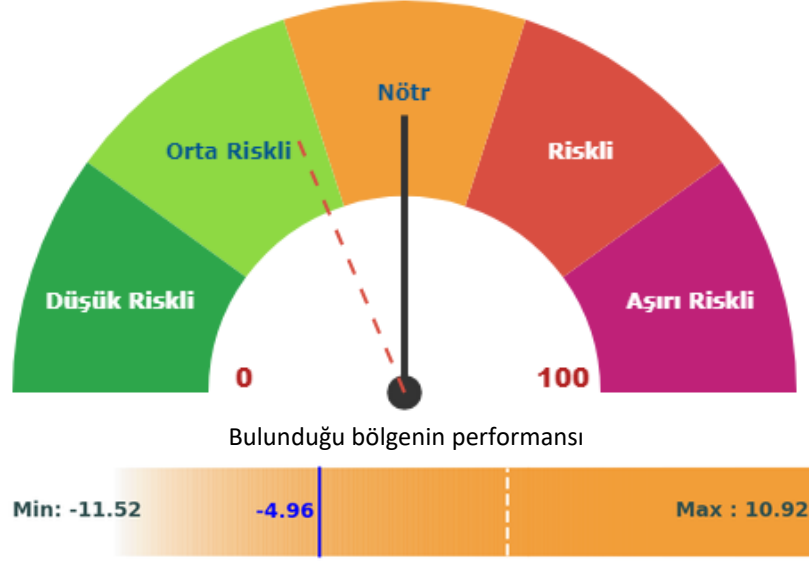
GÜMÜŞ

29 Temmuz - 4 Temmuz 2024

Geçen hafta orta riskli bölgeyi test eden Gümüş modeli bu hafta **nötr bölgeye** dönüş yapmıştır.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftada gümüş fiyatları yaklaşık **%5.5 değer kaybetmiştir**. Model nötr bölgeye girdiğinden beri gümüşün **performansı tarihsel ortalamasının altında bulunmaktadır**.

Bu hafta **50** Bir hafta önce **37** Bir ay önce **42**

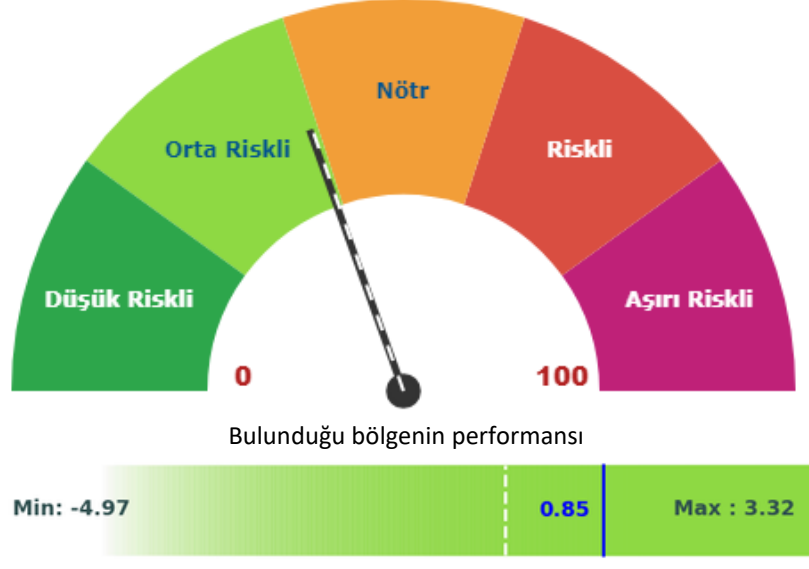


GBPUSD

GBPUSD modeli 1 aylık dönemde düşük riskli yöne ilerlerken bu hafta **orta riskli** bölgede konumunu korumuştur.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda GBPUSD paritesi yaklaşık **%2 değer kazanırken**, model orta riskli bölgeye girdiğinden beri parite **getirisi bu bölge içinde sağladığı ortalama getirinin üzerinde bulunmaktadır**.

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

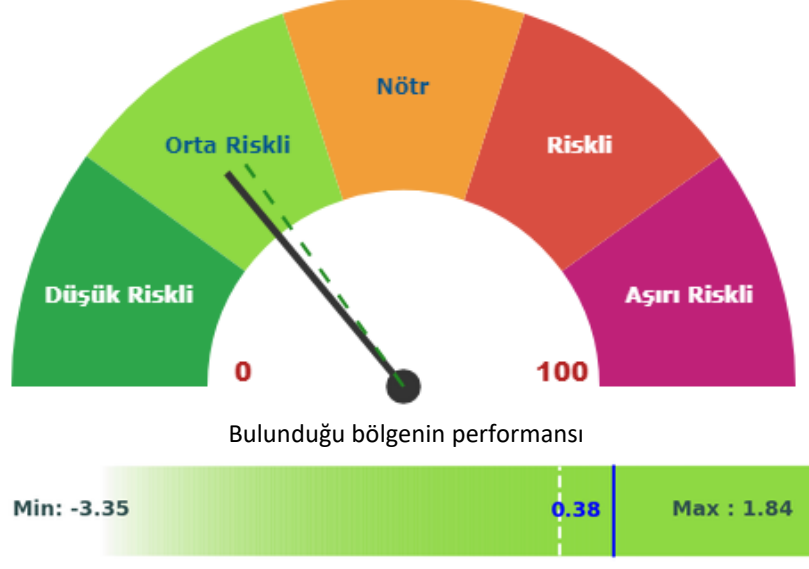


EURUSD

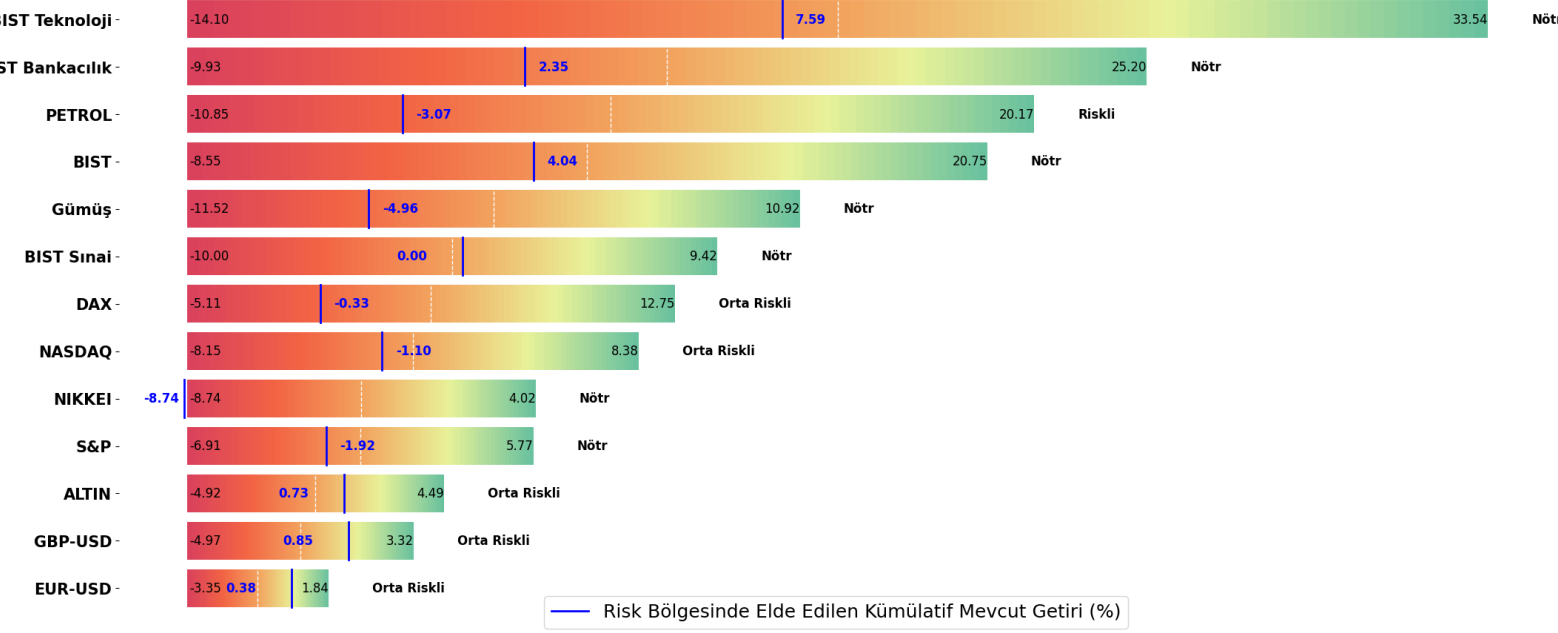
EURUSD modeli 1 aylık dönemde riskli bölgeden **orta riskli bölgeye** geçiş yapmıştır.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda EURUSD paritesi yaklaşık **%1.5 değer kazanmıştır**. Model orta riskli bölgeye girdiğinden beri parite **getirisi bu bölgedeki tarihsel ortalamasının üzerinde yer almaktadır**.

Bu hafta **28** Bir hafta önce **30** Bir ay önce **69**

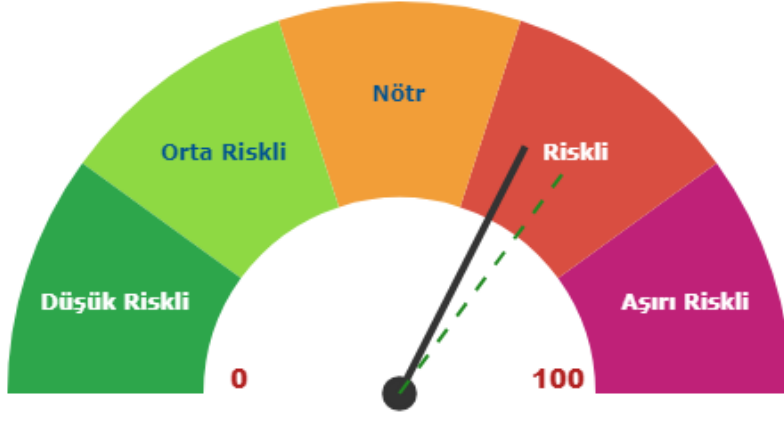


Bulunduğu Bölgeye Göre Getiri Bantları



*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

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.”