

RİSKOMETRE

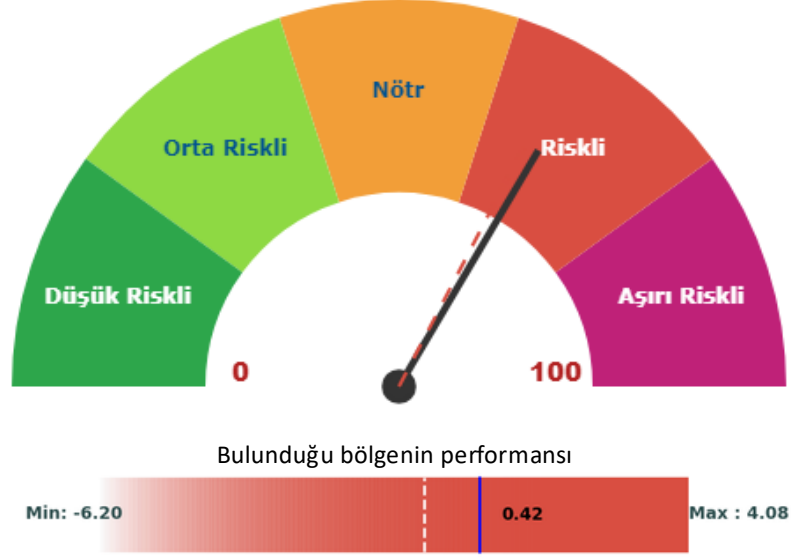
BIST100

21 - 27 Ekim 2024

1 aylık dönemde aşırı riskli yöne ilerleyen BIST 100 modeli bu hafta **riskli bölge** içinde konumunu korumuştur.

BIST100 Endeksi, modelin riskli yöne ilerlediği 1 ayda **yaklaşık %9 değer kaybetmiştir**. Model riskli bölgeye girdiğinden beri BIST100 Endeksi performansı, bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır**.

Bu hafta **67** Bir hafta önce **67** Bir ay önce **53**

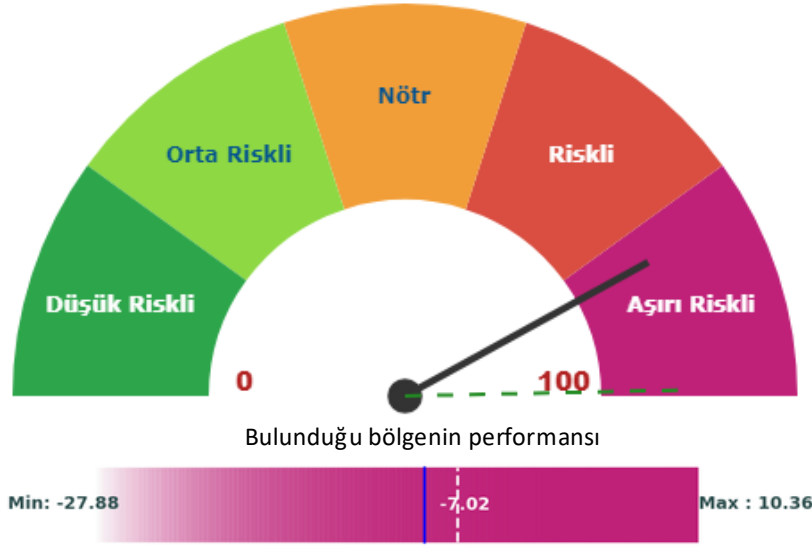


BIST TEKNOLOJİ

1 aylık dönemde **aşırı riskli bölgede** bulunan BIST Teknoloji Modeli bu hafta düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada BIST Teknoloji Endeksi yaklaşık **%5.5 değer kazanmıştır**. Model bu bölgeye girdiğinden beri BIST Teknoloji Endeksi getirisi **tarihsel ortalamasının altında bulunmaktadır**.

Bu hafta **84** Bir hafta önce **99** Bir ay önce **88**

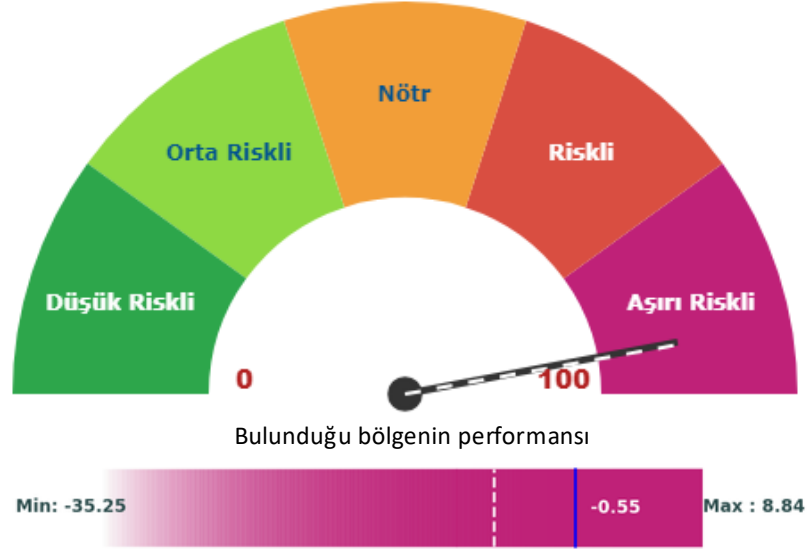


BIST BANKACILIK

BIST Bankacılık modeli 1 aylık dönemde **aşırı riskli bölge** içinde aşırı riskli yöne ilerlerken bu hafta konumunu korumuştur.

Modelin aşırı riskli yöne ilerlediği 1 ayda BIST Bankacılık Endeksi yaklaşık **%9 değer kaybetmiştir**. Model bu bölgeye girdiğinden beri BIST Bankacılık Endeksi performansı bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır**.

Bu hafta **94** Bir hafta önce **94** Bir ay önce **89**



BIST SINAI

BIST Sınai modeli 1 aylık dönemde **riskli bölge** içinde aşırı riskli yöne ilerlemiştir.

BIST Sınai Endeksi, modelin aşırı riskli yöne ilerlediği 1 ayda yaklaşık **%8.5 değer kaybetmiştir**. Model riskli bölgeye girdiğinden beri BIST Sınai Endeksi performansı bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında seyretmektedir**.

Bu hafta **64** Bir hafta önce **65** Bir ay önce **61**

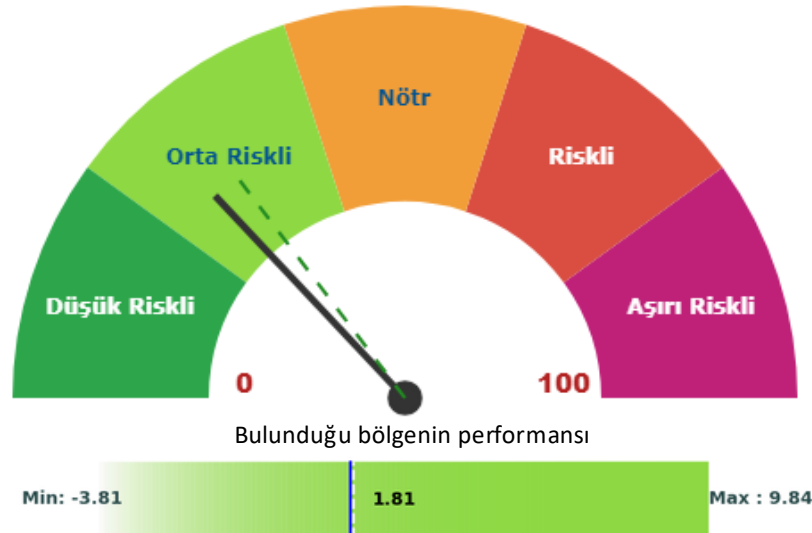


ALTIN

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

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada Altın fiyatları yaklaşık **%2 değer kazanmıştır**. Model bu bölgeye girdiğinden beri Altının getirisi bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının yakınlarında yer almaktadır**.

Bu hafta **26** Bir hafta önce **29** Bir ay önce **20**



RİSKOMETRE

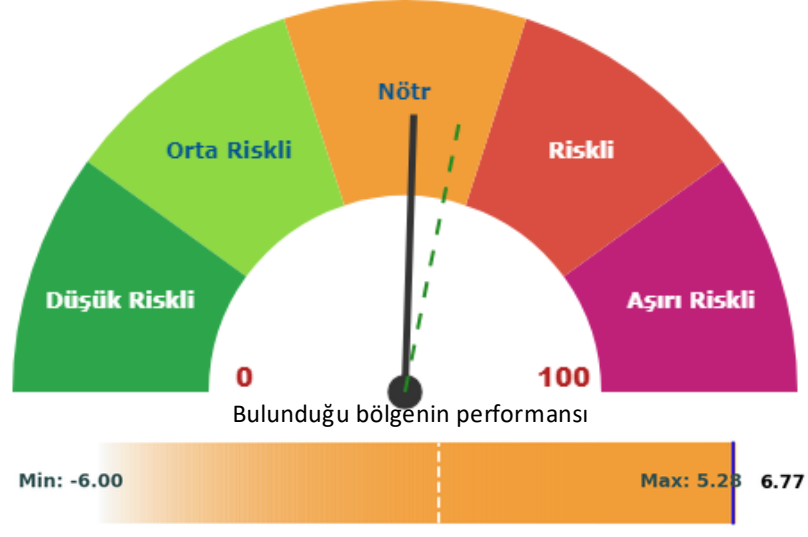
S&P

21 - 27 Ekim 2024

ABD Hisse Senedi modeli 1 aylık dönemde **nötr bölge** içinde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda endeks yaklaşık **%2.5 değer kazanmıştır**. Model nötr bölgeye girdiğinden beri S&P Endeksinin performansı, bu bölgedeki **tarihsel maksimum değerine ulaşmıştır**.

Bu hafta **51** Bir hafta önce **56** Bir ay önce **53**

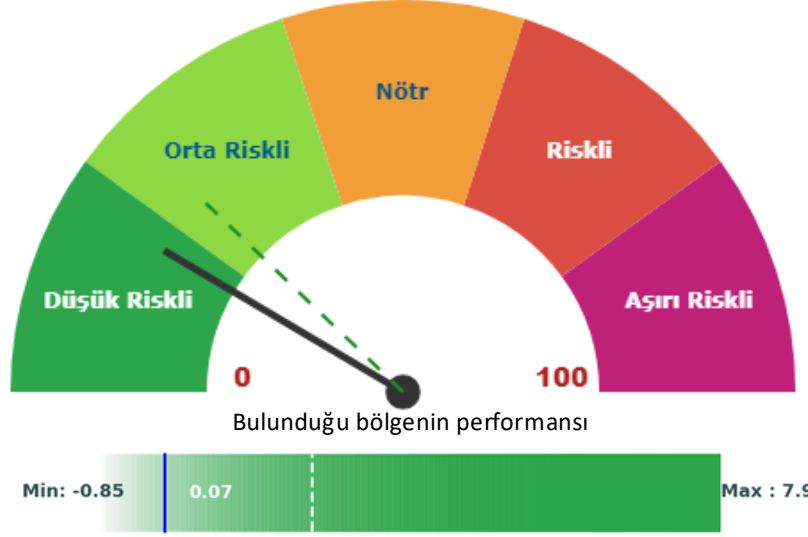


NASDAQ

Nasdaq Modeli bu hafta orta riskli bölgeden **düşük riskli bölgeye** geçiş yapmıştır.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda endeks yaklaşık **%2 getiri sağlamıştır**. Model düşük riskli bölgeye girdiğinden beri endeksin getirisi bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında yer almaktadır**.

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

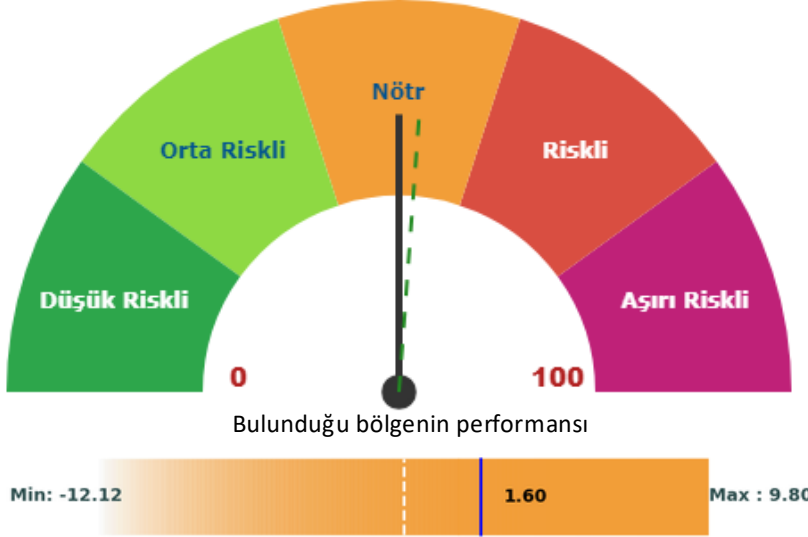


DAX

1 aylık dönemde orta riskli bölgeden **nötr bölgeye** geçiş yapan Almanya hisse senedi modeli bu hafta düşük riskli yöne ilerlemiştir.

DAX Endeksi, modelin nötr sinyal verdiği 1 haftada yaklaşık **%1.5 değer kazanmıştır**. DAX Endeksi performansı nötr bölgeye girdiğinden beri bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerindedir**.

Bu hafta **50** Bir hafta önce **52** Bir ay önce **38**

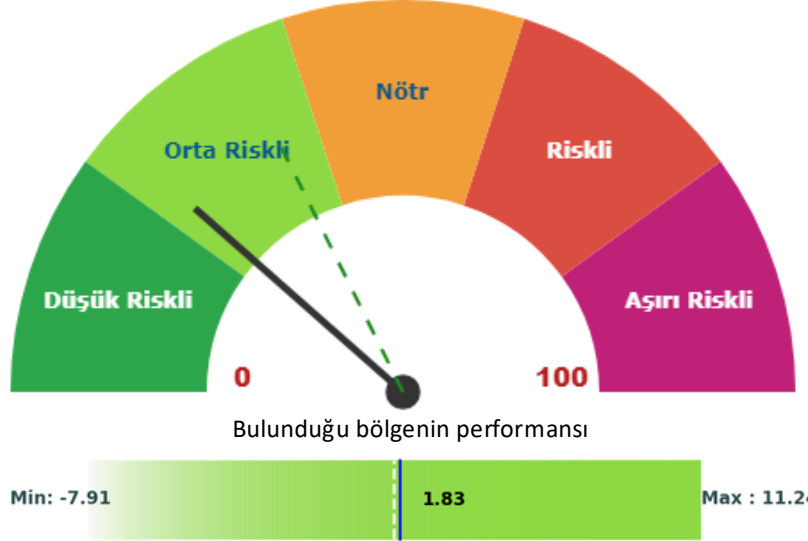


NIKKEI

Japonya Hisse Senedi modeli 1 aylık dönemde **orta riskli bölge** içinde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Nikkei Endeksi, modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda yaklaşık **%7.5 değer kazanmıştır**. Nikkei Endeksinin getirisi orta riskli bölgeye girdiğinden beri bu bölgedeki **tarihsel ortalaması yakınlarında bulunmaktadır**.

Bu hafta **23** Bir hafta önce **35** Bir ay önce **35**

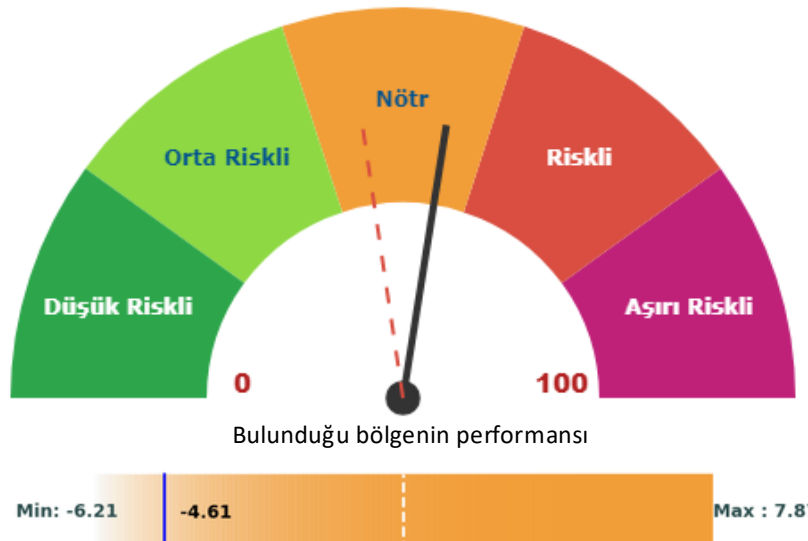


PETROL

1 ay önce aşırı riskli bölgede yer alan Petrol modeli, bu hafta **nötr bölge** içinde riskli yöne ilerlemiştir.

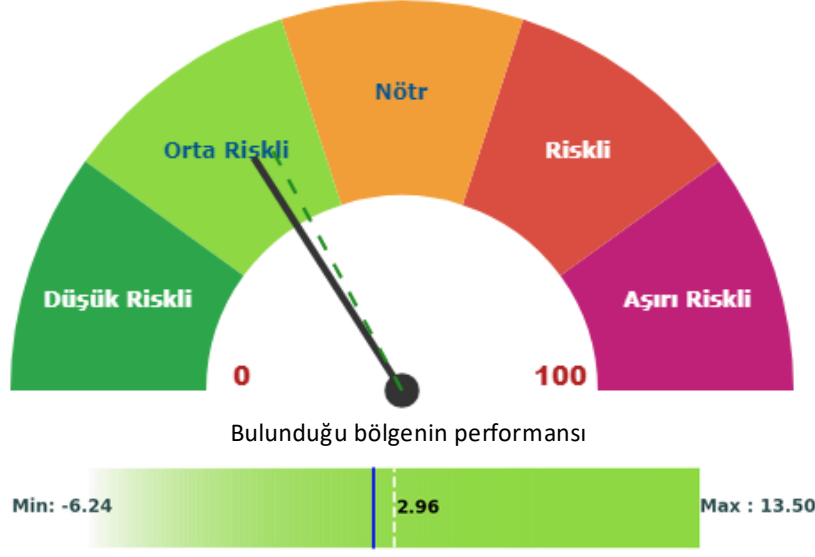
Modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftada Petrol fiyatları yaklaşık **%6.5 değer kaybetmiştir**. Model nötr bölgeye girdiğinden beri petrolün getirisi nötr bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında bulunmaktadır**.

Bu hafta **55** Bir hafta önce **45** Bir ay önce **86**



Gümüş modeli 1 aylık dönemde **orta riskli bölgede** yer alırken düşük riskli yöne ilerlemiştir.

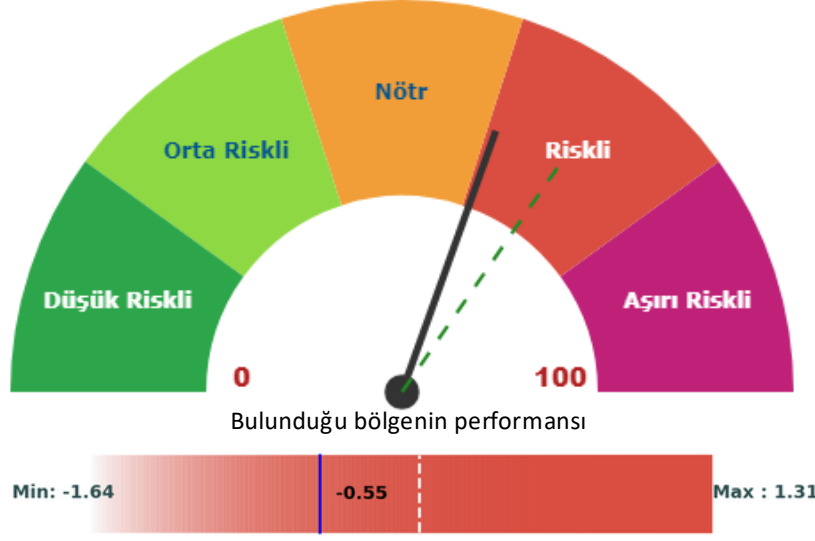
Gümüş fiyatları, modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada yaklaşık **%3 değer kazanmıştır**. Gümüşün getirisi orta riskli bölgede bulunduğu sürede bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında bulunmaktadır**.



GBPUSD

1 aylık dönemde orta riskli bölgeden **riskli bölgeye** geçiş yapan GBPUSD modeli bu hafta düşük riskli yöne ilerlemiştir.

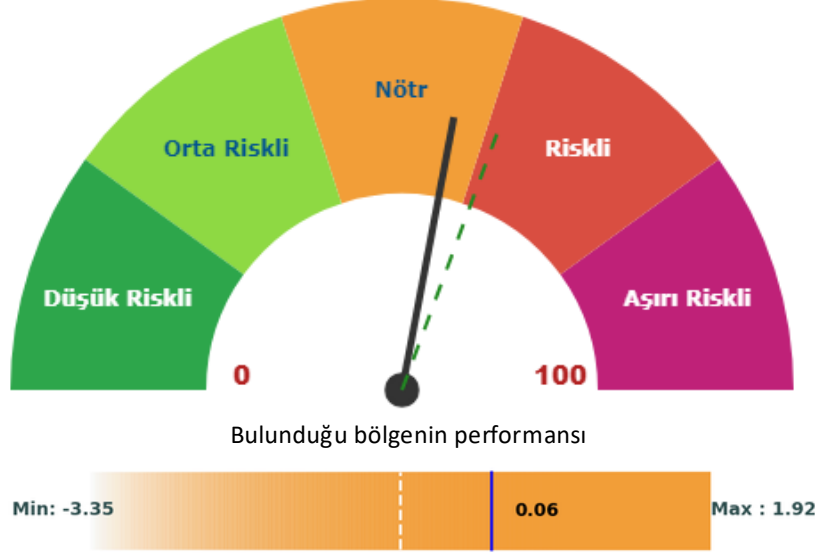
GBPUSD paritesi, modelin riskli yöne ilerlediği 1 ayda yaklaşık **%2 değer kaybetmiştir**. GBPUSD parite getirisi riskli bölgeye girdiğinden beri bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında bulunmaktadır**.



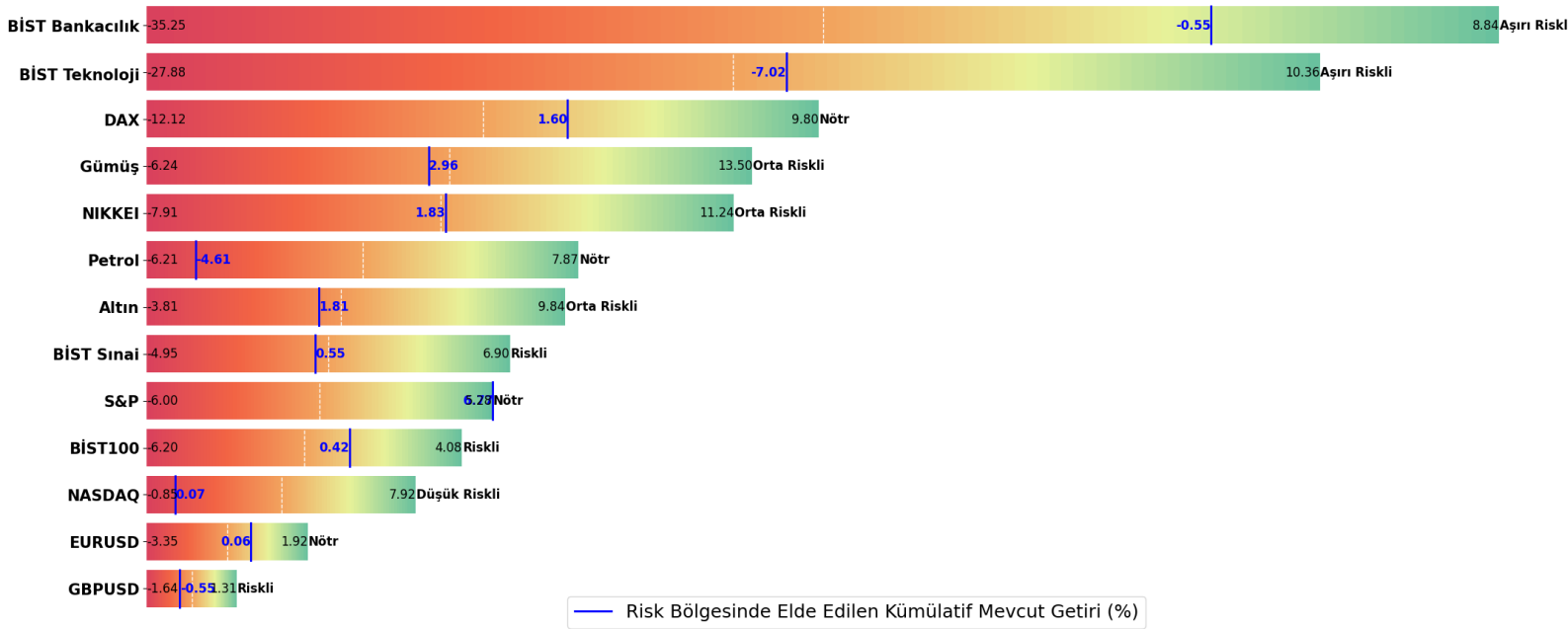
EURUSD

EURUSD modeli 1 aylık dalgalı hareketinin ardından bu hafta **nötr bölgededir**.

Modelin nötr bölgeye geçiş yaptığı 1 aylık dönemde EURUSD paritesi yaklaşık **%3 değer kaybı yaşamıştır**. EURUSD paritesi performansı nötr bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır**.

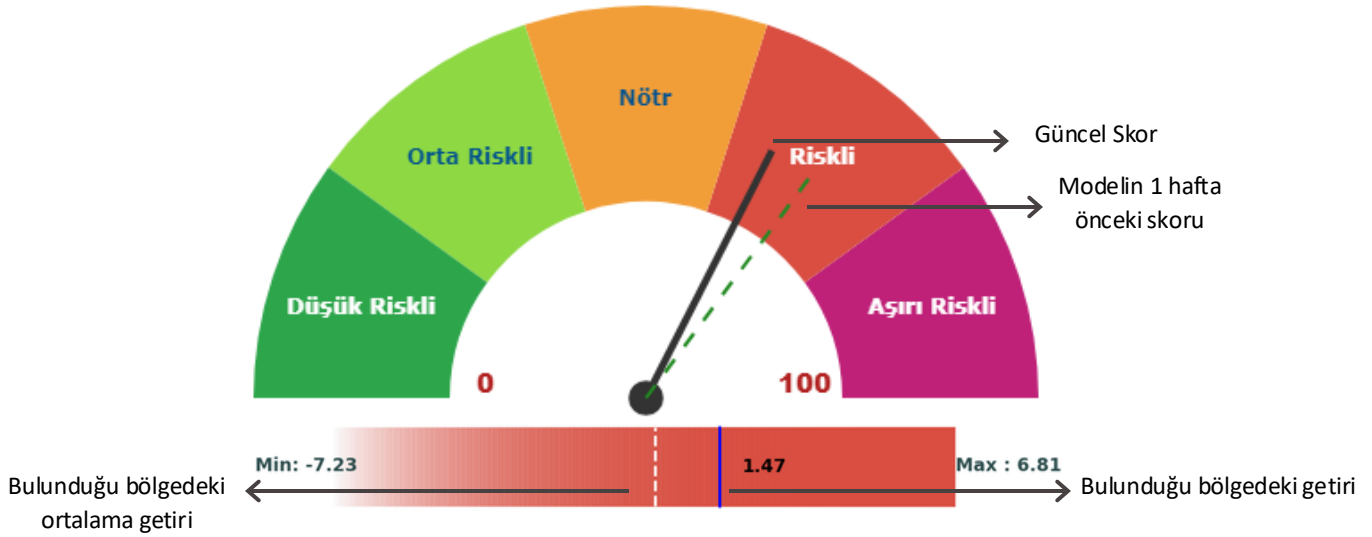


Bulunduğu Bölgeye Göre Getiri Bantları



*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:



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 dayanarak 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 dayanarak yapılacak ileriye dönük yatırımlar ve ticari işlemlerin sonuçlarından ya da ortaya çıkabilecek zararlardan Fibabanka A.Ş sorumlu tutulamaz.”