

# RİSKOMETRE

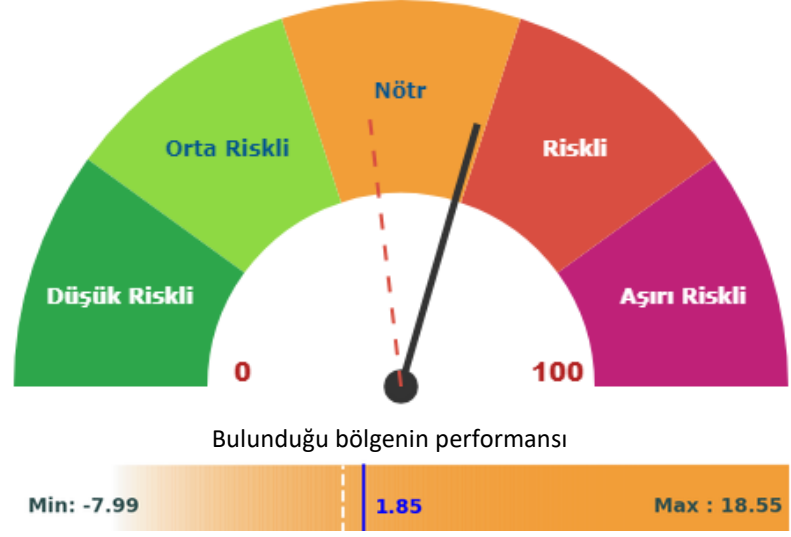
## BIST100

29 Nisan - 5 Mayıs 2024

1 aylık dönemde riskli yöne ilerleyen BIST100 modeli **nötr bölge** içinde riskli bölge sınırına yaklaşmıştır.

Piyasanın risk algısının artmasına rağmen 1 aylık dönemde BIST100 modeli yaklaşık **%7 getiri sağlamış**, model nötr bölgeye girdiğinden beri endeksin **getirisi bu bölgedeki ortalamasının üzerine ulaşmıştır.**

Bu hafta **59** Bir hafta önce **46** Bir ay önce **38**

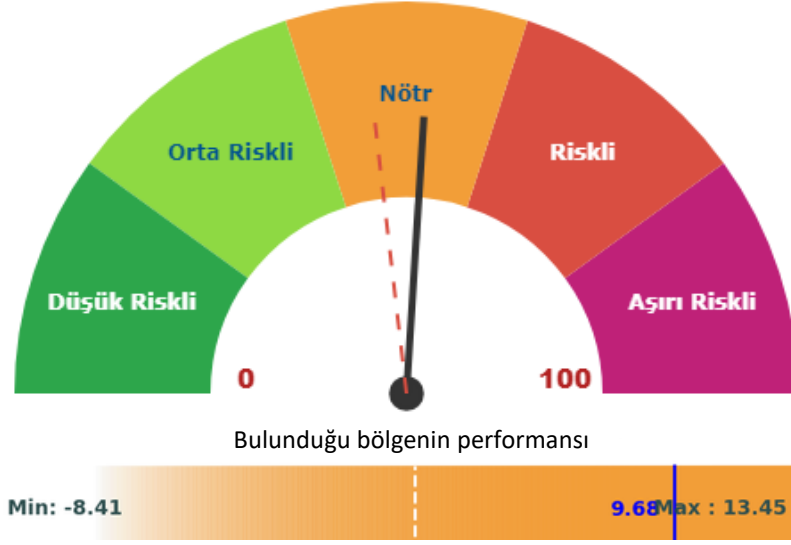


## BIST30

BIST30 modeli bu hafta **nötr bölge** içinde riskli yöne ilerleyerek 1 ay önceki konumuna dönüş yapmıştır.

Modelin dalgalı seyrettiği 1 ayda BIST30 Endeksi yaklaşık **%7.5 değer kazanmıştır.** Modelin nötr bölgede bulunduğu süre boyunca endeksin **getirisi tarihsel ortalamasının üzerinde bir performans sergilemiştir.**

Bu hafta **52** Bir hafta önce **46** Bir ay önce **52**

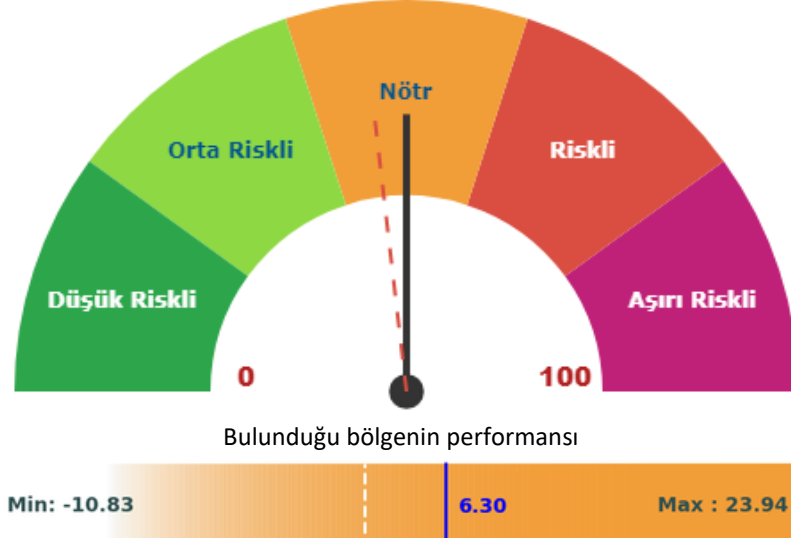


## BIST BANKACILIK

Ay ortasında orta riskli bölgeyi test eden BIST Bankacılık Endeksi bu hafta **nötr bölge** içinde riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda BIST Bankacılık Endeksi yaklaşık **%17 değer kazanmıştır.** Model nötr bölgeye girdiğinden beri endeksin **getiri performansı tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır.**

Bu hafta **50** Bir hafta önce **46** Bir ay önce **52**

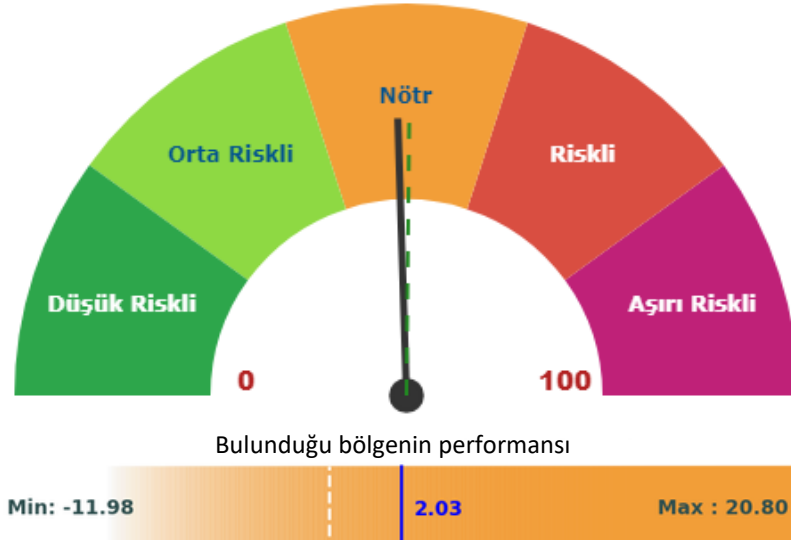


## BIST SINAI

BIST Sınai modeli bu hafta **nötr bölge** içinde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda BIST Sınai Endeksi yaklaşık **%4 değer kazanırken**, model nötr bölgeye girdiğinden beri endeksin **getirisi bu bölgedeki tarihsel ortalamasının üzerinde seyretmektedir.**

Bu hafta **49** Bir hafta önce **50** Bir ay önce **51**

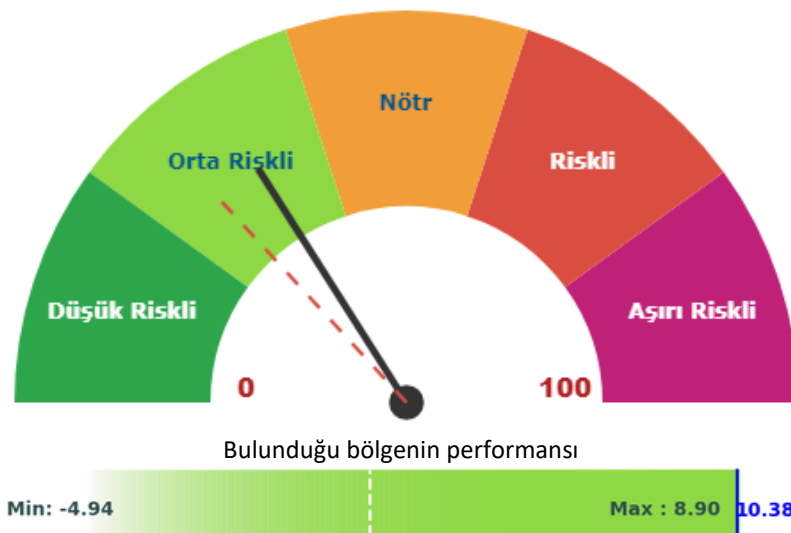


## ALTIN

Altın modeli bu hafta **orta riskli bölge** içinde riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin orta risk sinyali verdiği 1 ayda altın fiyatları yaklaşık **%4.5 değer kazanırken** orta riskli bölge içinde bulunduğu süre boyunca altının **getirisi tarihsel maksimum değerine ulaşmıştır.**

Bu hafta **32** Bir hafta önce **26** Bir ay önce **29**



# RİSKOMETRE

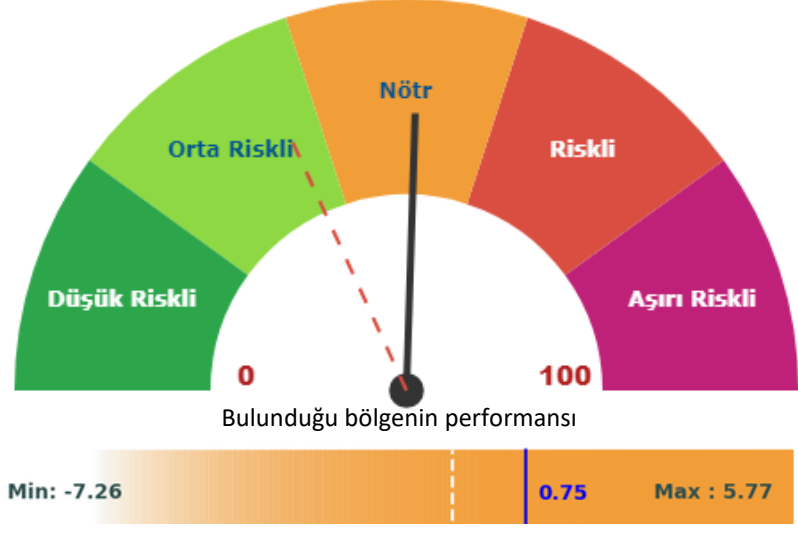
S&P

29 Nisan - 5 Mayıs 2024

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

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 ayda S&P Endeksi yaklaşık **%4 değer kaybetmiştir**. Model orta riskli bölgeye girdiğinden beri endeks **getirisi bu bölgedeki tarihsel performansının üstünde bulunmaktadır**.

Bu hafta **51** Bir hafta önce **36** Bir ay önce **27**

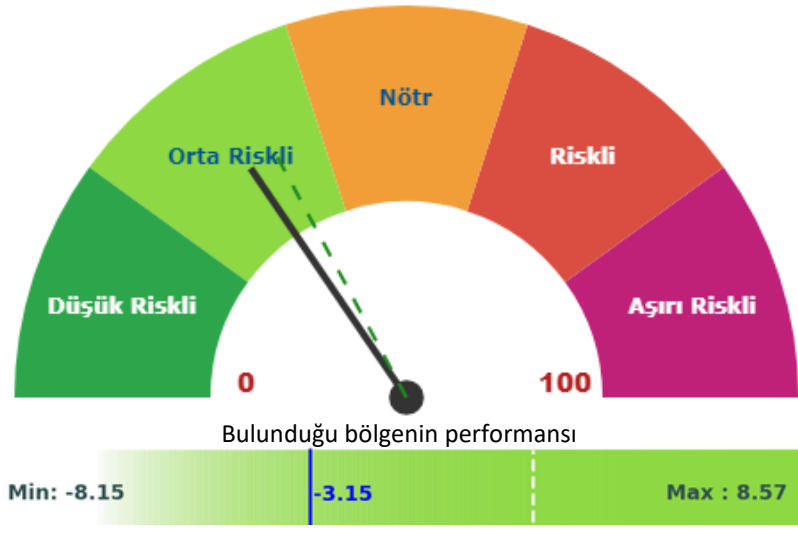


## NASDAQ

Hafta başında düşük riskli bölgeyi test eden NASDAQ modeli riskli yöne ilerleyerek **orta riskli bölgeye** dönüş yapmıştır.

NASDAQ Endeksi, modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada yaklaşık **%2.5 değer kazanmış**, riskli yöne ilerlediği 1 aylık dönemde ise yaklaşık **%4.5 değer kaybetmiştir**.

Bu hafta **31** Bir hafta önce **34** Bir ay önce **27**

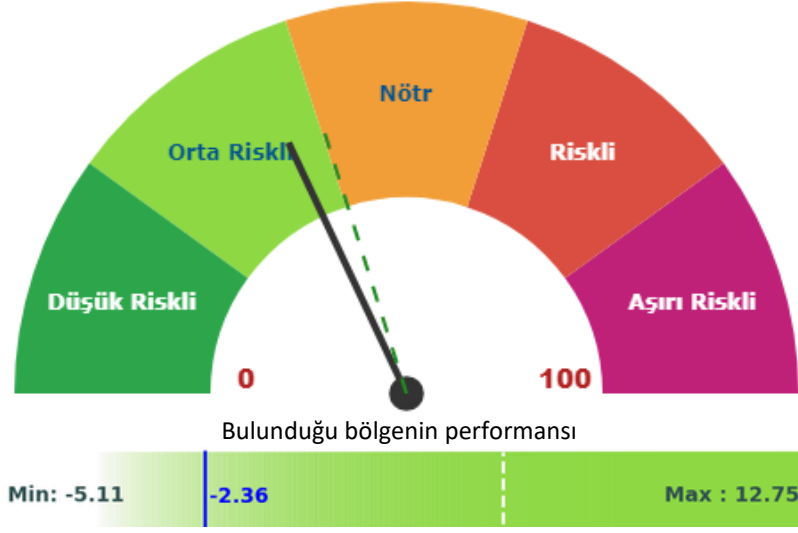


## DAX

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

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 ayda DAX Endeksi yaklaşık **%2.5 değer kaybetmiş** ve düşük riskli bölgeye girdiğinden beri **getirisi bölge ortalamasının altında kalmıştır**.

Bu hafta **36** Bir hafta önce **40** Bir ay önce **20**

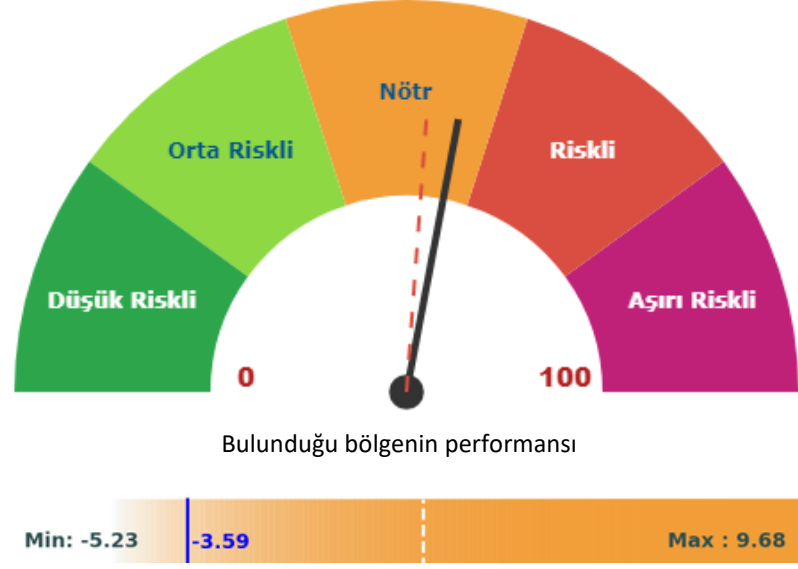


## NIKKEI

1 ayda orta riskli bölgeden nötr bölgeye geçen Japonya Hisse Senedi Modeli bu hafta **nötr bölge** içinde riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 ayda yaklaşık **%6 değer kaybeden** Nikkei Endeksinin nötr bölgedeki **performansı tarihsel ortalamasının altında kalmıştır**.

Bu hafta **56** Bir hafta önce **52** Bir ay önce **40**

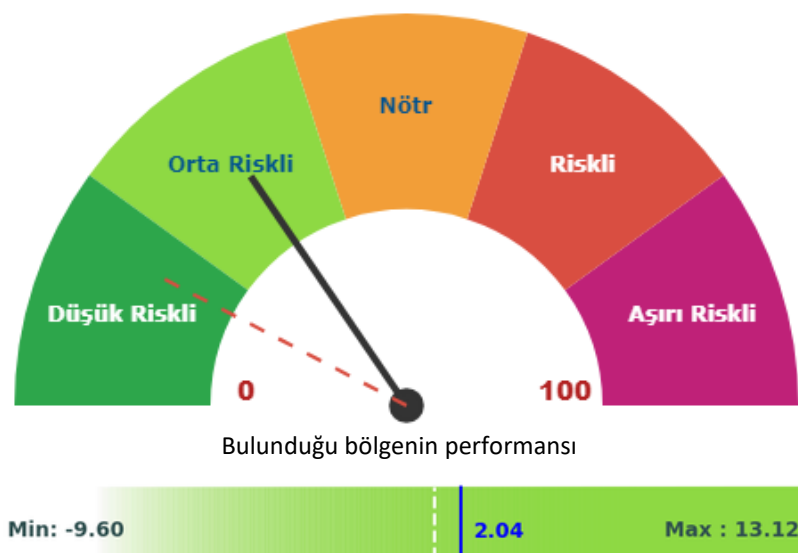


## PETROL

Petrol modeli bu hafta düşük riskli bölgeden **orta riskli bölgeye** geçiş yapmıştır.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda Petrol fiyatları yaklaşık **%2 değer kazanmıştır**. Model orta riskli bölgeye girdiğinden beri petrol fiyatlarının **getirisi tarihsel ortalamasının üzerinde seyretmektedir**.

Bu hafta **31** Bir hafta önce **15** Bir ay önce **35**



# RİSKOMETRE

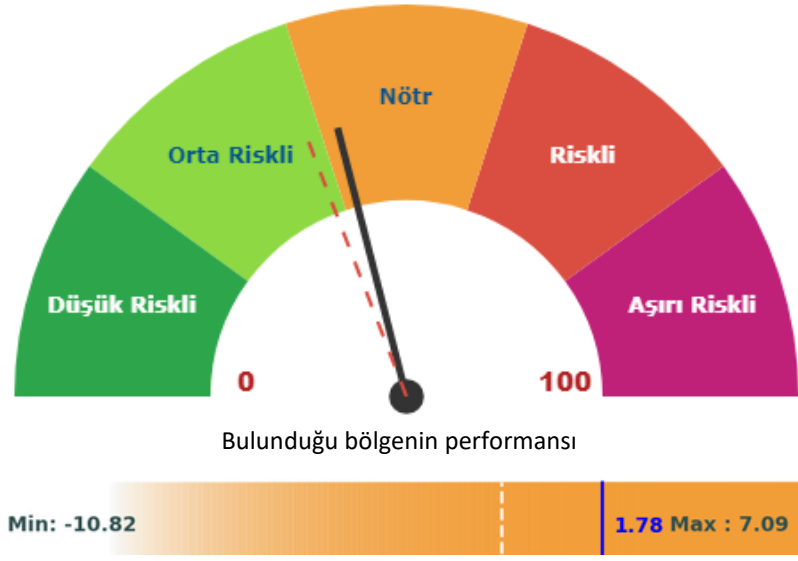
## GÜMÜŞ

29 Nisan - 5 Mayıs 2024

Geçen hafta orta riskli bölgede bulunan Gümüş modeli bu hafta **nötr bölgeye** geçiş yapmıştır.

Modelin dalgalı seyrettiği 1 ayda gümüş fiyatları yaklaşık **%10 değer kazanmıştır**. Model nötr bölgeye geçiş yaptığından beri gümüşün **performansı nötr bölge ortalamasının üzerinde bulunmaktadır**.

Bu hafta **42** Bir hafta önce **38** Bir ay önce **42**

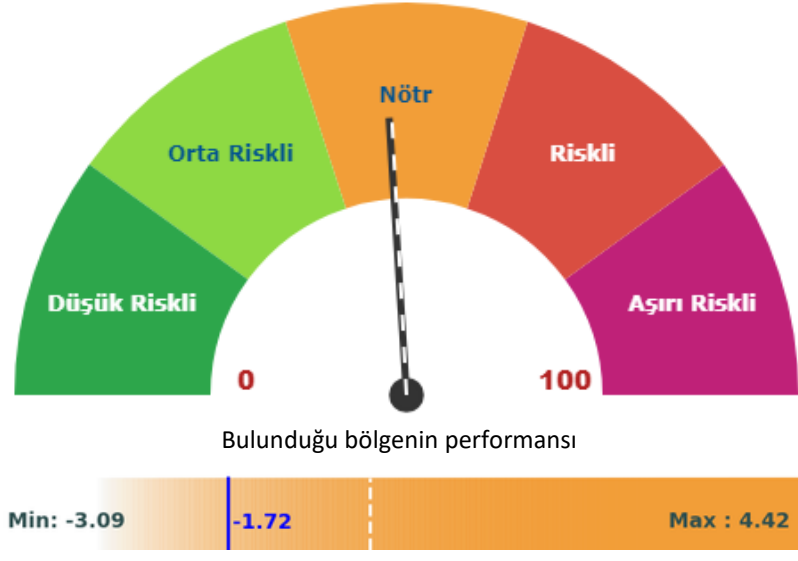


## GBPUSD

GBPUSD modeli bu hafta bulunduğu **nötr bölge** içinde konumunu korumuştur.

Modelin orta risk sinyali verdiği 1 haftada GBPUSD paritesi yaklaşık **%1.2 değer kazanırken**, parite getirisi bu bölge içinde sağladığı **ortalama getiri değerinin altında kalmıştır**.

Bu hafta **48** Bir hafta önce **48** Bir ay önce **43**

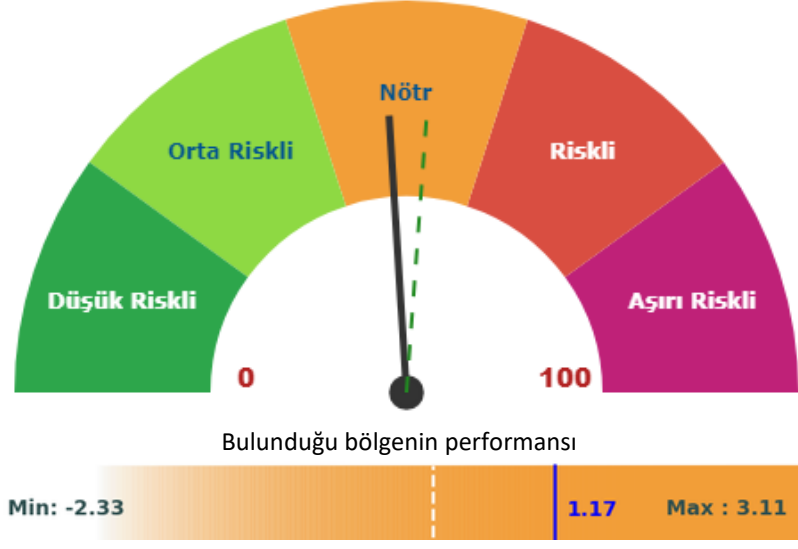


## EURUSD

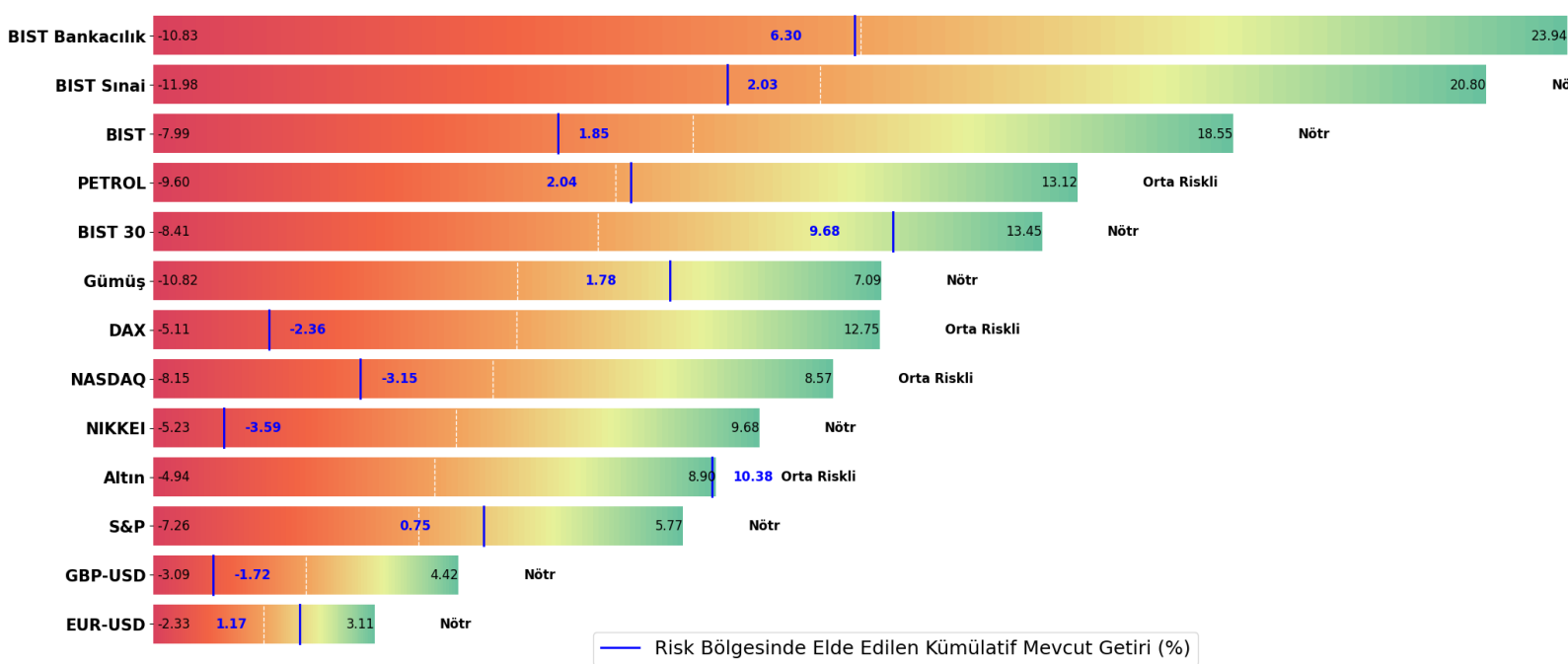
EURUSD modeli bu hafta nötr bölge içinde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada EURUSD paritesi yaklaşık **%1 değer kazanmıştır**. Model nötr bölgeye girdiğinden beri parite **getirisi tarihsel ortalamasının üzerinde seyretmektedir**.

Bu hafta **48** Bir hafta önce **52** Bir ay önce **39**

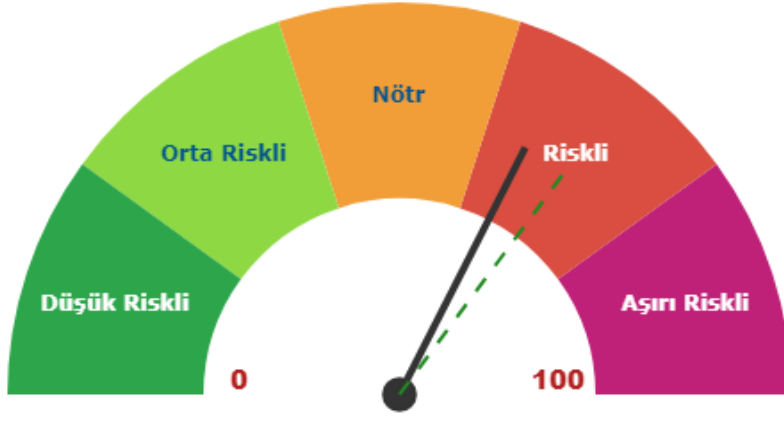


## Bulunduğu Bölgeye Göre Getiri Bantları



\*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](http://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.”