

RİSKOMETRE

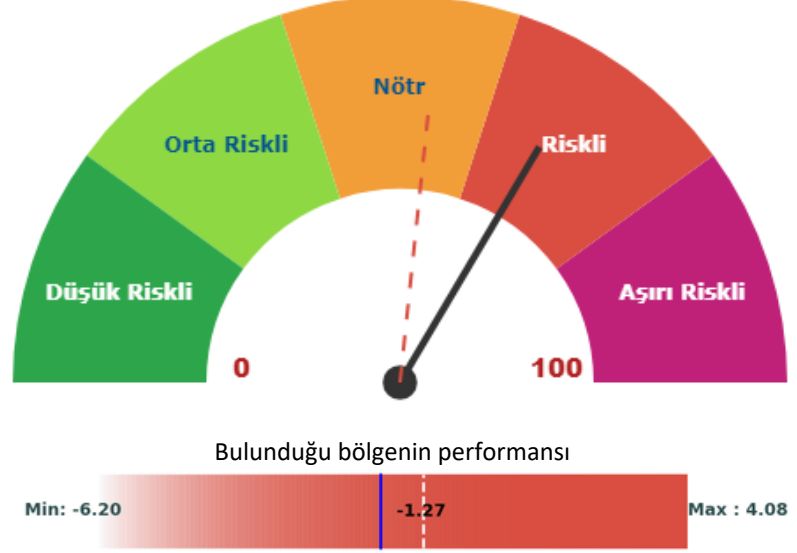
BIST100

7 -13 Ekim 2024

BIST100 modeli bu hafta **nötr bölgeden** riskli bölgeye geçiş yapmıştır.

Modelin aşırı riskli yöne ilerlediği 1 ayda BIST100 Endeksi yaklaşık **%10.5 değer kaybetmiştir**. Model riskli bölgeye girdiğinden beri BIST100 Endeksi performansı, bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında bulunmaktadır**.

Bu hafta **67** Bir hafta önce **53** Bir ay önce **60**

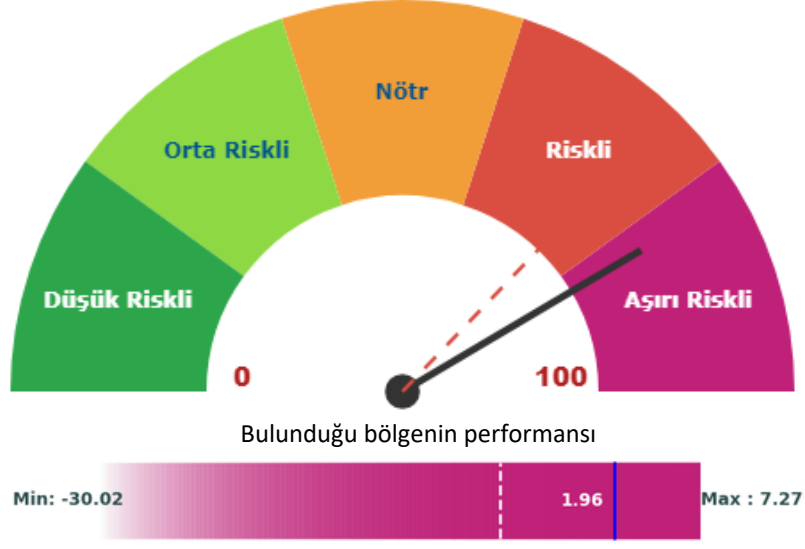


BIST TEKNOLOJİ

1 aylık dönemde aşırı riskli yöne ilerleyen BIST Teknoloji modeli bu hafta **aşırı riskli** bölgeye geçiş yapmıştır.

Modelin aşırı riskli yöne ilerlediği 1 ayda BIST Teknoloji Endeksi yaklaşık **%7 değer kaybetmiştir**. Model bu bölgeye girdiğinden beri BIST Teknoloji Endeksi getirisi **tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır**.

Bu hafta **83** Bir hafta önce **74** Bir ay önce **78**

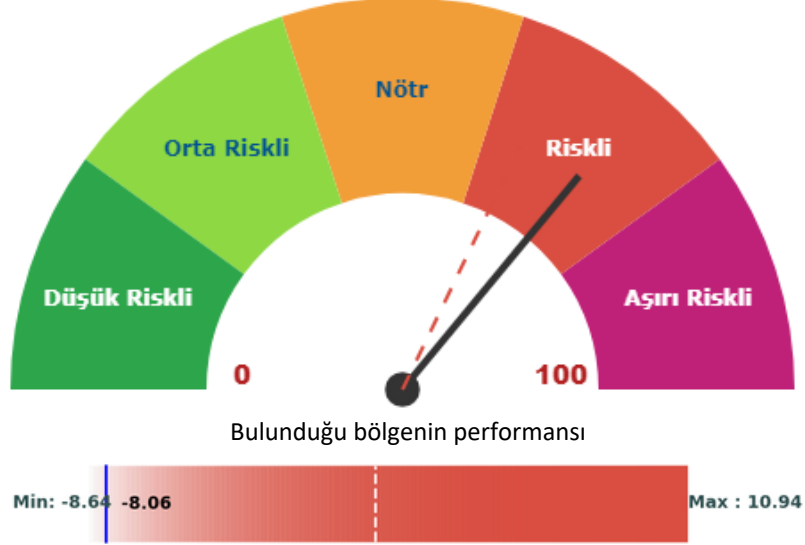


BIST BANKACILIK

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

Modelin riskli bölge içinde riskli yöne ilerlediği 1 haftada BIST Bankacılık Endeksi yaklaşık **%13.5 değer kaybetmiştir**. Model riskli bölgeye girdiğinden beri BIST Bankacılık Endeksi performansı bu bölgedeki **minimum değeri yakınlarında bulunmaktadır**.

Bu hafta **72** Bir hafta önce **64** Bir ay önce **69**



BIST SİNAİ

1 aylık dönemde dalgalı seyreden BIST Sınai Modeli **riskli bölgeye** dönüş yapmıştır.

BIST Sınai Endeksi, modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftada yaklaşık **%7.5 değer kaybetmiştir**. Model riskli bölgeye girdiğinden beri BIST Sınai Endeksi performansı bu bölgedeki tarihsel **ortalamasının altında bulunmaktadır**.

Bu hafta **62** Bir hafta önce **60** Bir ay önce **62**

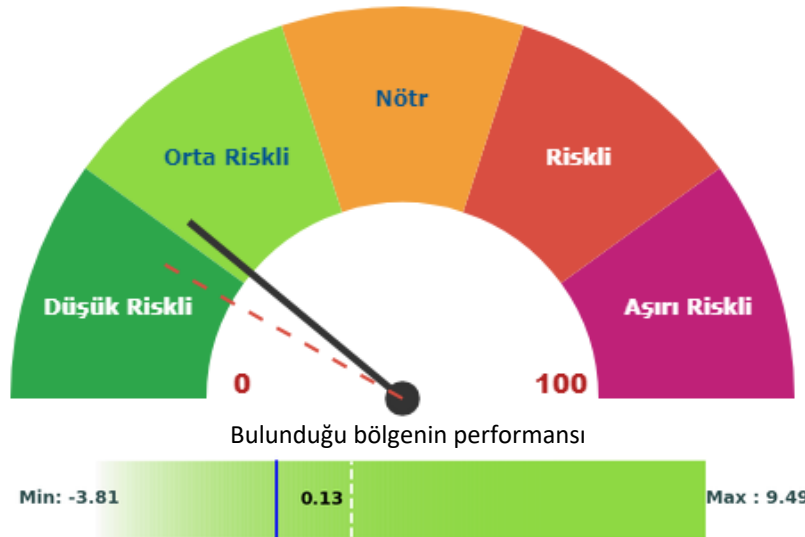


ALTIN

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

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda Altın fiyatları yaklaşık **%6.5 değer kazanmıştır**. Model bu bölgeye girdiğinden beri Altının getirisi bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında yer almaktadır**.

Bu hafta **22** Bir hafta önce **16** Bir ay önce **29**



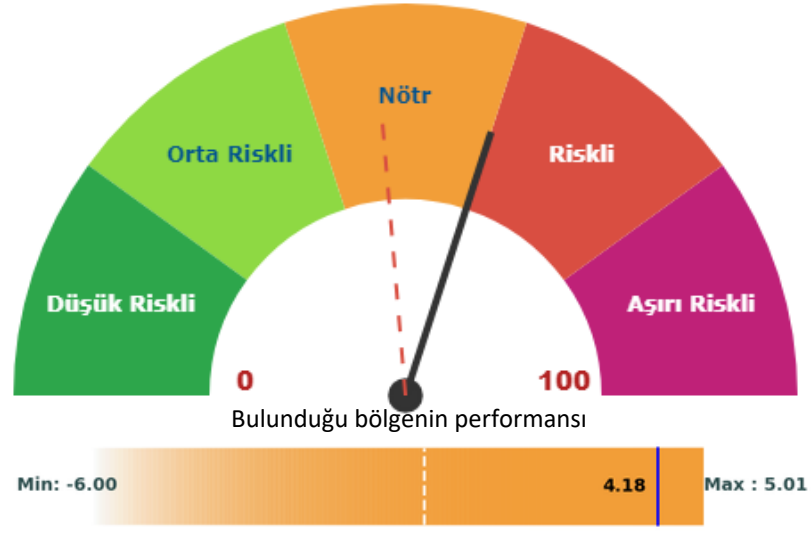
RİSKOMETRE

S&P

7 -13 Ekim 2024

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

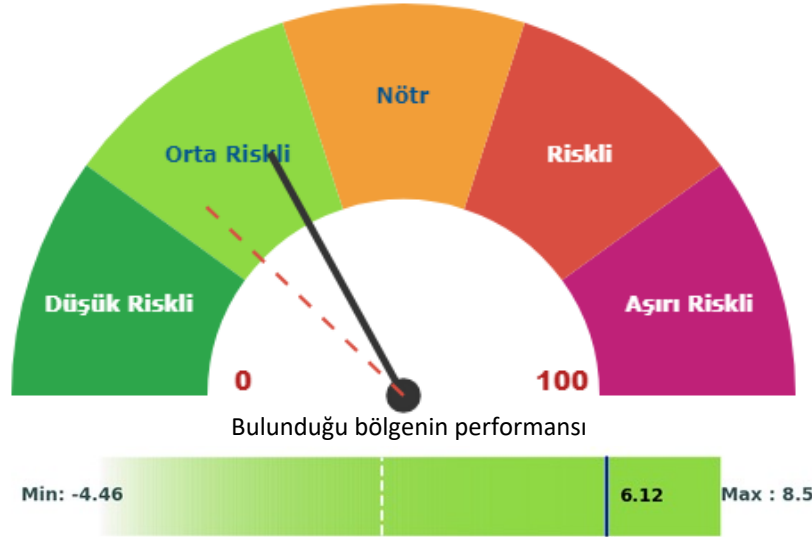
Modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftada endeks yaklaşık **%1 değer kaybetmiştir**. Model nötr bölgeye girdiğinden beri S&P Endeksinin performansı, bu bölgedeki **tarihsel maksimum değeri yakınına ulaşmıştır**.



NASDAQ

1 haftalık dönemde **orta riskli** bölgede riskli yöne ilerleyen NASDAQ modeli 1 aylık dönemde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

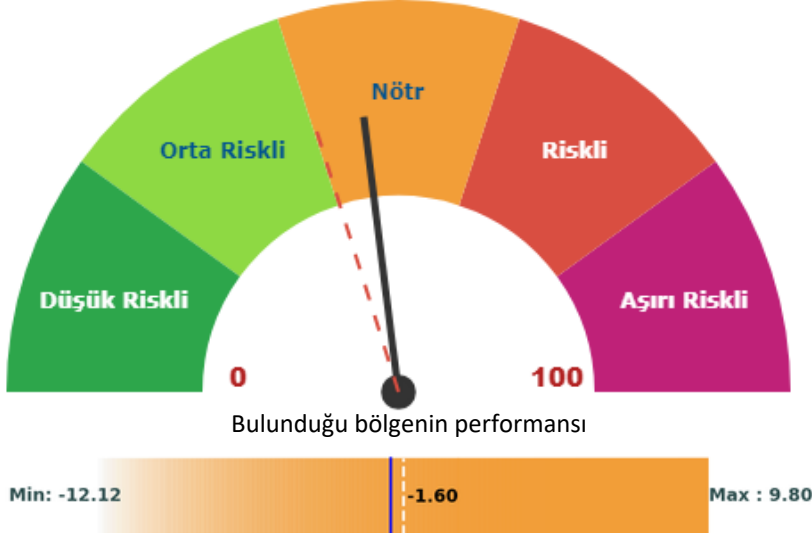
Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda NASDAQ Endeksi yaklaşık **%5 getiri sağlamıştır**. Model orta riskli bölgeye girdiğinden beri endeksin getirisi bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerindedir**.



DAX

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

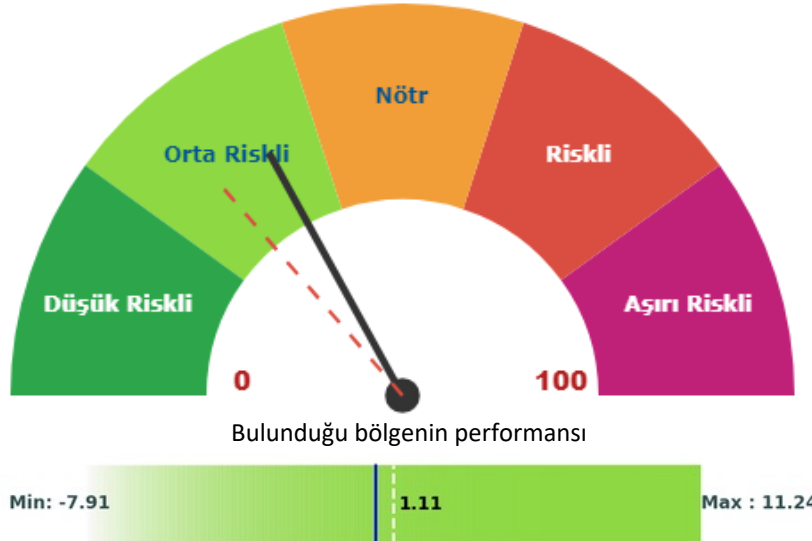
DAX Endeksi, modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftada **%2.35 değer kaybetmiştir**. DAX Endeksi performansı nötr bölgeye girdiğinden beri bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altındadır**.



NIKKEI

Japonya Hisse Senedi modeli 1 haftada **orta riskli bölge** içinde riskli yöne ilerleyerek 1 ay önceki konumuna dönüş yapmıştır.

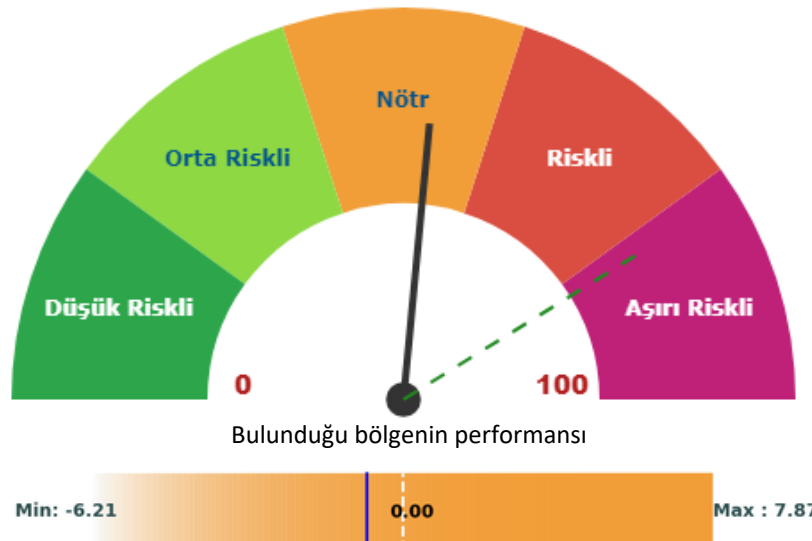
Nikkei Endeksi, modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftada **%3 değer kaybetmiştir**. Nikkei Endeksi getirisi orta riskli bölgeye girdiğinden beri **tarihsel ortalamasının altında bulunmaktadır**.



PETROL

Petrol modeli geçen hafta bulunduğu aşırı riskli bölgeden bu hafta düşük riskli yöne ilerleyerek **nötr bölgeye** geçiş yapmıştır.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda Petrol fiyatları yaklaşık **%10.5 değer kazanmıştır**. Model bu bölgeye girdiğinden beri petrolün getirisi bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında bulunmaktadır**.



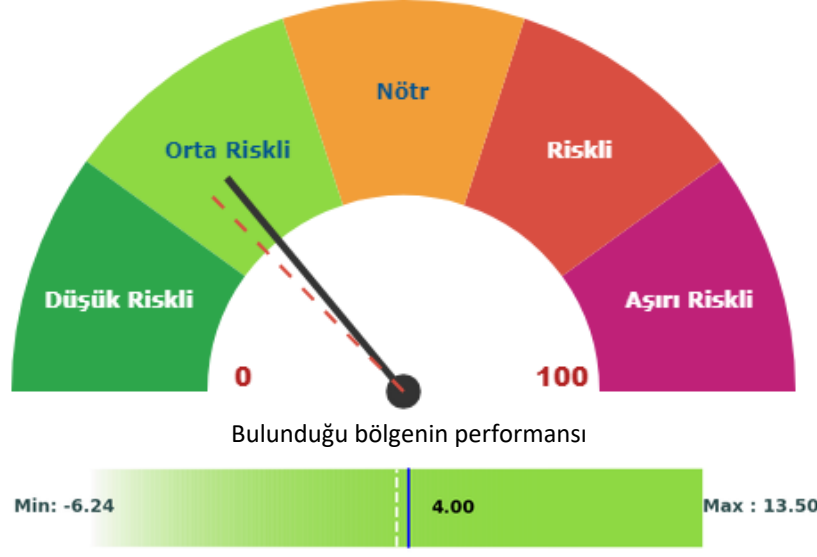
RİSKOMETRE

GÜMÜŞ

7 -13 Ekim 2024

Gümüş modeli bu hafta **orta riskli bölgede** riskli yöne ilerlerken 1 aylık dönemde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

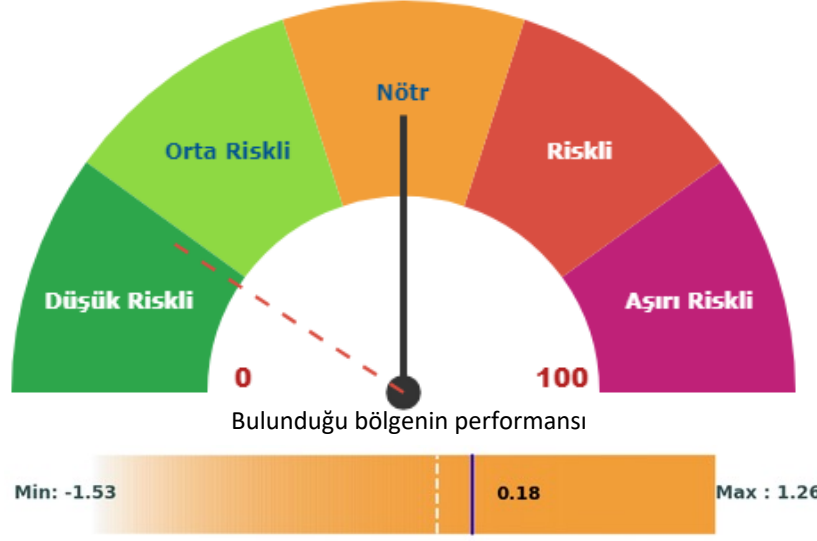
Gümüş fiyatları modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda yaklaşık **%15 değer kazanmıştır**. Gümüş getirisi orta riskli bölgede bulunduğu süreçte **tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır**.



GBPUSD

GBPUSD modeli 1 aylık dönemde riskli yöne ilerleyerek **nötr bölgeye** geçiş yapmıştır.

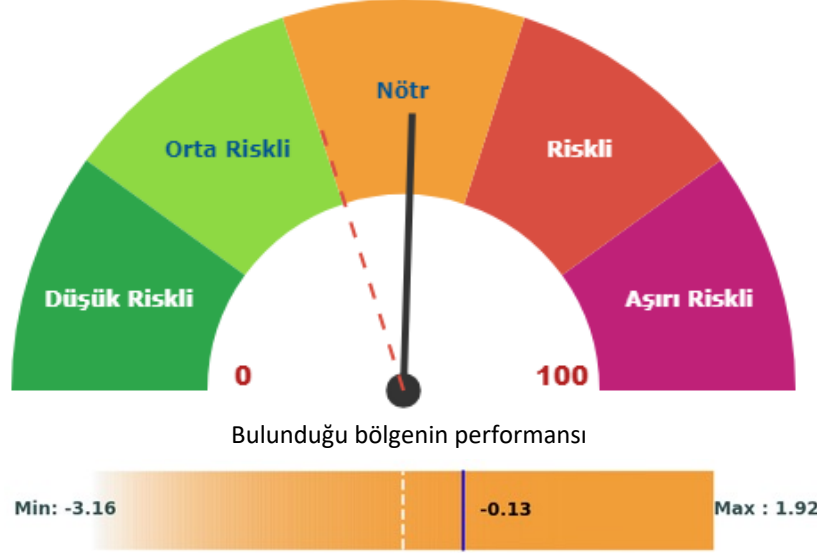
GBPUSD paritesi, modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftada yaklaşık **%2 değer kaybetmiştir**. GBPUSD paritesi getirisi nötr bölgeye girdiğinden beri **tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır**.



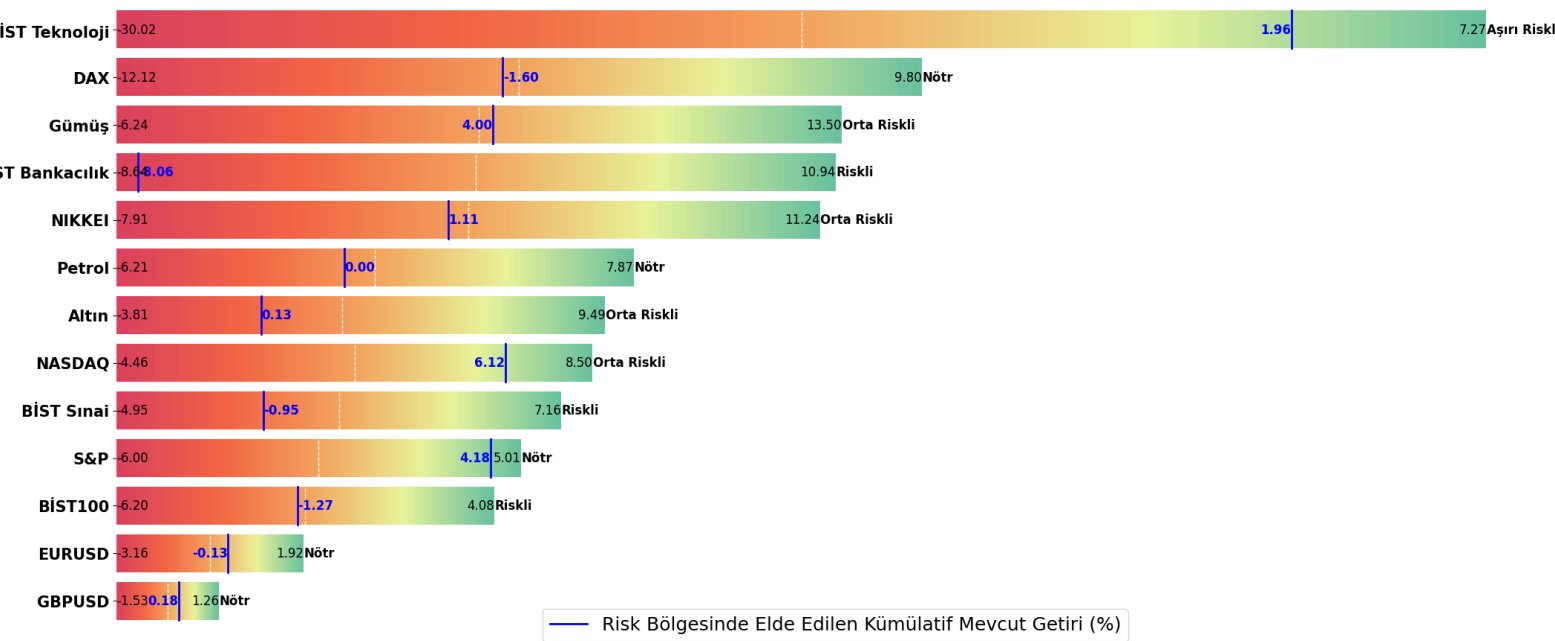
EURUSD

Geçen hafta orta riskli bölgeyi test eden EURUSD modeli bu hafta riskli yöne ilerleyerek **nötr bölgeye** dönüş yapmıştır.

Model 1 haftalık dönemde riskli yöne ilerlerken EURUSD paritesi yaklaşık **%1.2 değer kaybı yaşamıştır**. EURUSD paritesi performansı nötr bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır**.

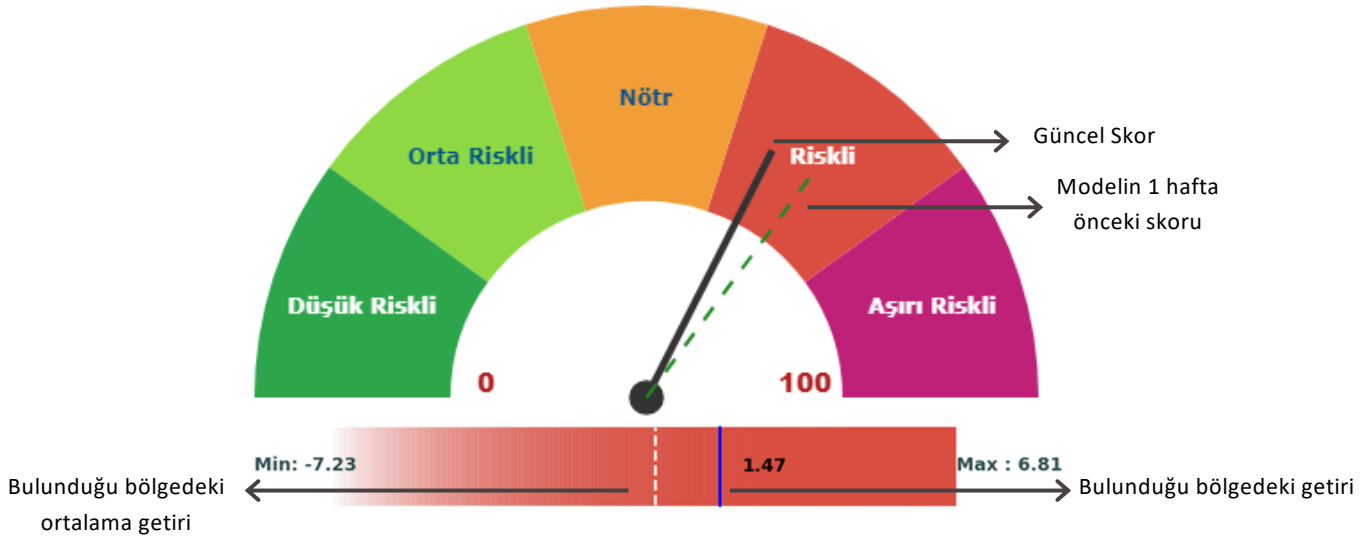


Bulunduğu Bölgeye Göre Getiri Bantları



*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:

arfcap
www.arf.capital

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.”