

# RİSKOMETRE

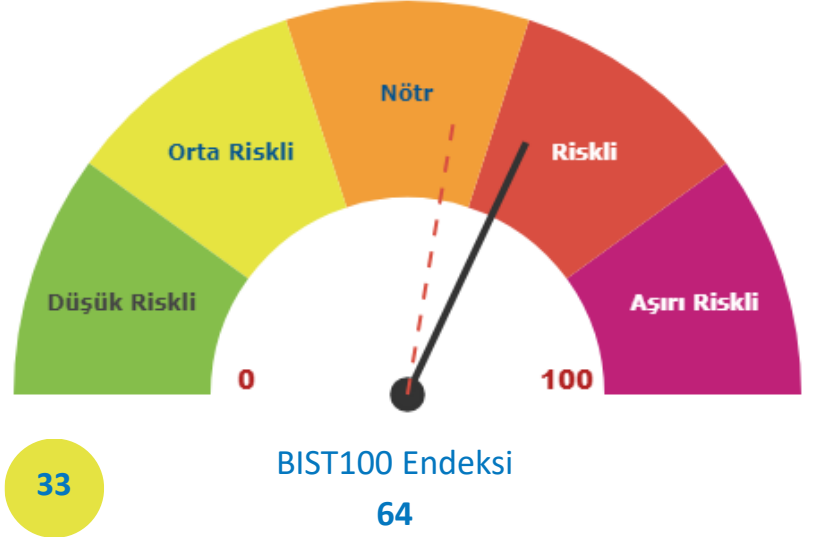
## BIST100

30 Ekim - 5 Kasım 2023

BIST100 modeli 1 aylık ve 1 haftalık dönemde riskli yönde hareketini sürdürüyor.

Modelin nötr bölgeden **riskli** bölgeye geçişi ile BIST100 Endeksi **%2 değer kaybederken**, 1 aylık dönemde bu **değer kaybı %8** olarak gerçekleşmiştir.

Bu hafta **64** Bir hafta önce **55** Bir ay önce **33**

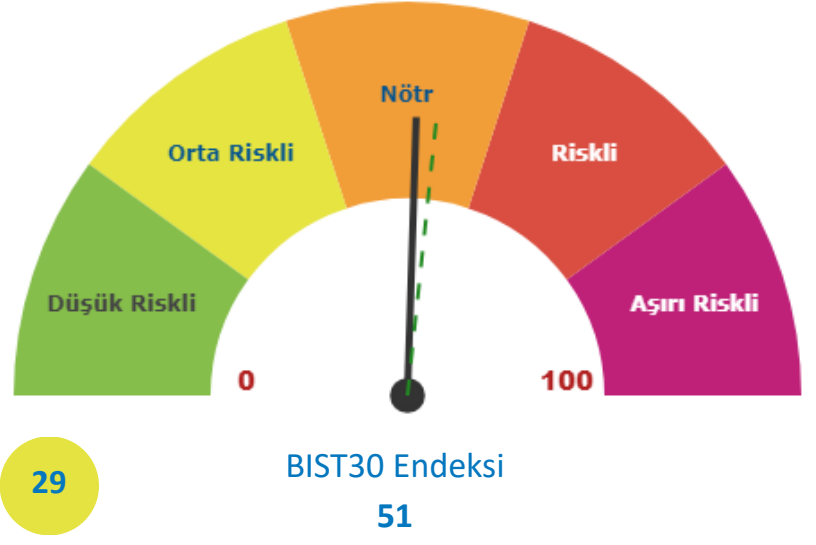


## BIST30

BIST30 Modeli bu hafta **nötr** bölge içinde düşük riskli yönde ilerlemiştir.

Modelin 1 ayda orta riskli bölgeden nötr bölgeye geçişinde BIST30 Endeksi **%9.5 değer kaybetmiştir**.

Bu hafta **51** Bir hafta önce **53** Bir ay önce **29**

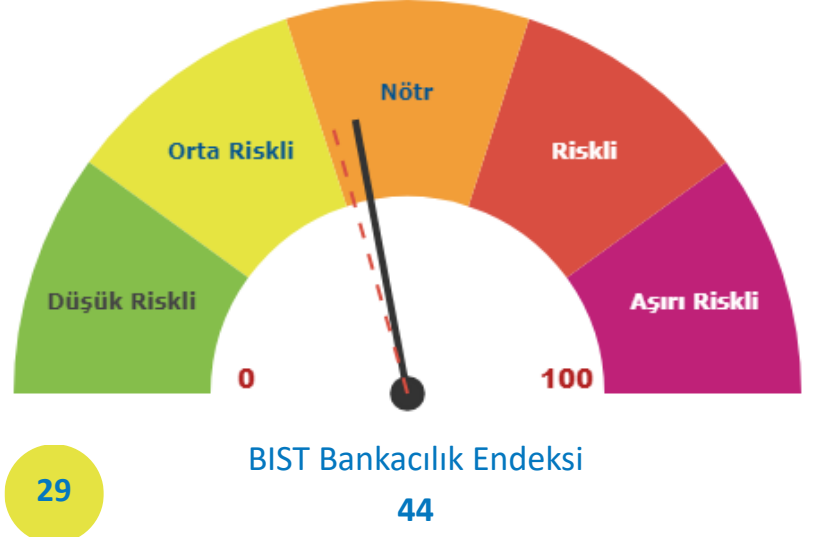


## BIST BANKACILIK

Geçen hafta **nötr** bölgeye geçiş yapan Bist Bankacılık Modeli bu hafta da aynı bölge içinde yer almaktadır.

Modelin 1 aylık riskli yöndeki hareketi esnasında BIST Bankacılık endeksi yaklaşık **%7 değer kaybetmiştir**.

Bu hafta **44** Bir hafta önce **41** Bir ay önce **29**

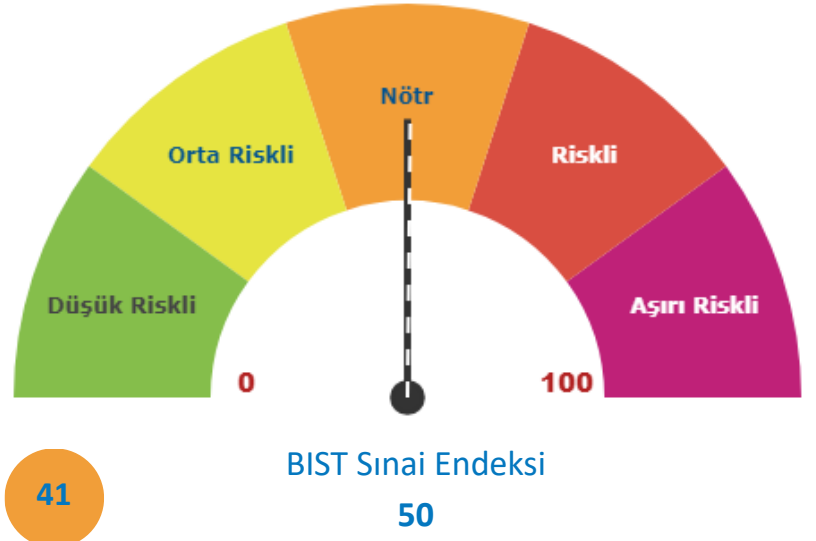


## BIST SINAI

BIST Sınai Modeli 1 aylık dönemde **nötr** bölge içinde riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin bu hareketi ile aynı dönemde BIST Sınai endeksinde yaklaşık **%9 değer kaybı** gözlenmiştir.

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

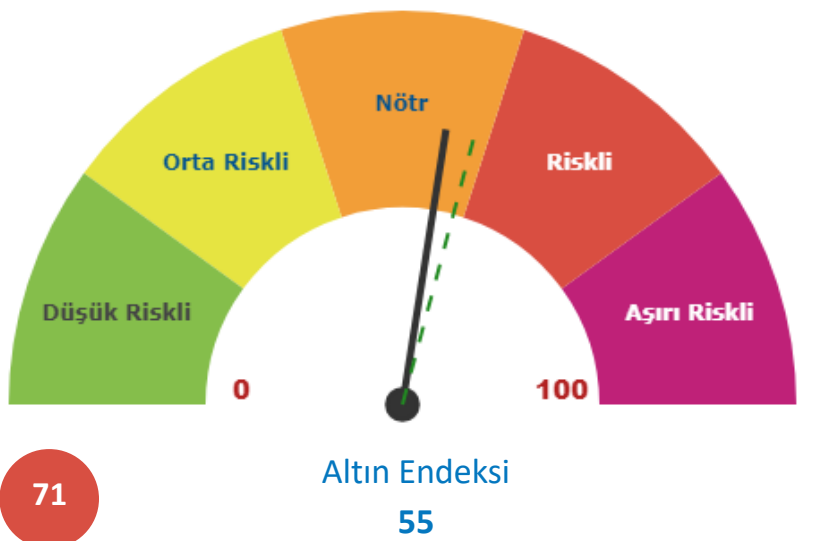


## ALTIN

Geçtiğimiz hafta **nötr** bölgeye geçiş yapan Altın modeli aynı bölge içinde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin 1 haftalık düşük riskli yönde hareketi ile aynı dönemde Altın fiyatları yaklaşık **%1**, 1 ayda ise **%8 değer kazanmıştır**.

Bu hafta **55** Bir hafta önce **58** Bir ay önce **71**



# RİSKOMETRE

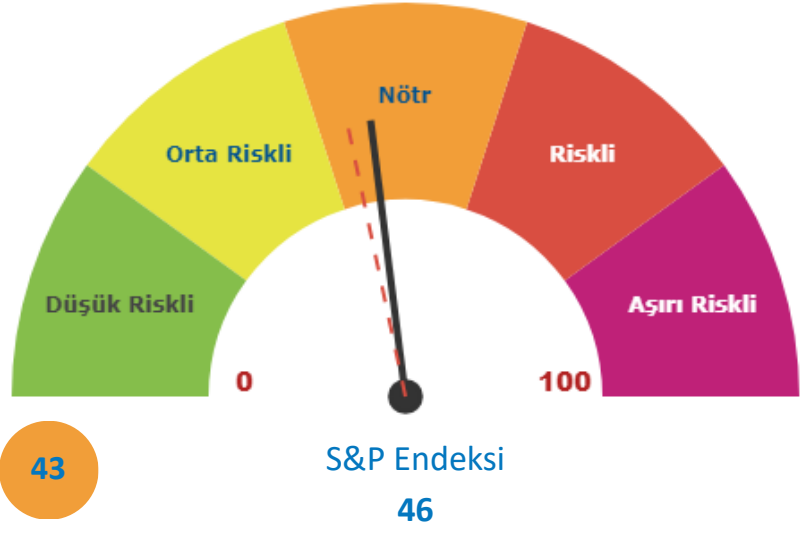
S&P

30 Ekim - 5 Kasım 2023

ABD Hisse Senedi modeli 1 aylık ve 1 haftalık dönemde **nötr** bölge içinde yer alırken bu hafta riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin 1 haftalık riskli yönde hareketi sırasında S&P Endeksi yaklaşık **%4 değer kaybı** yaşamıştır.

Bu hafta **46** Bir hafta önce **43** Bir ay önce **43**

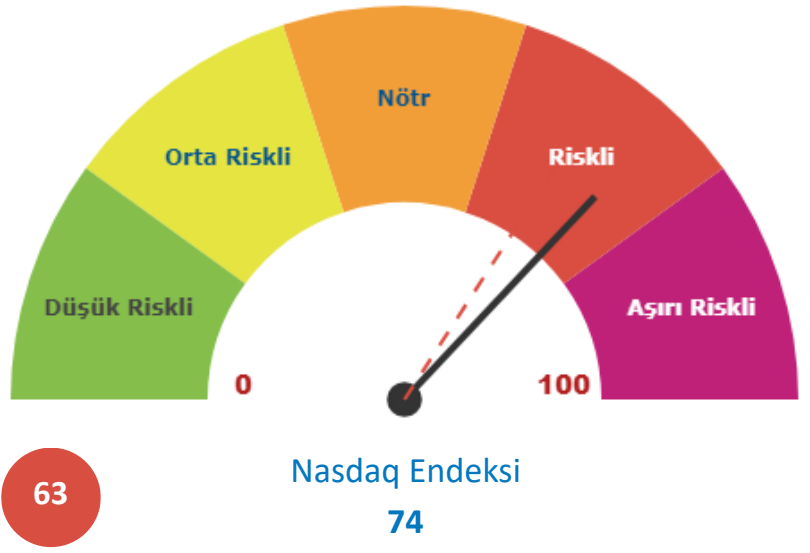


## NASDAQ

1 aydır **riskli** bölge içinde yer alan Nasdaq modeli bu hafta da riskli yöne ilerlemiştir.

Model riskli yönde ilerleyişi ile aynı dönemde Nasdaq Endeksi 1 haftada yaklaşık **%3**, 1 ayda ise yaklaşık **%4.5 değer kaybı** yaşamıştır.

Bu hafta **74** Bir hafta önce **68** Bir ay önce **63**

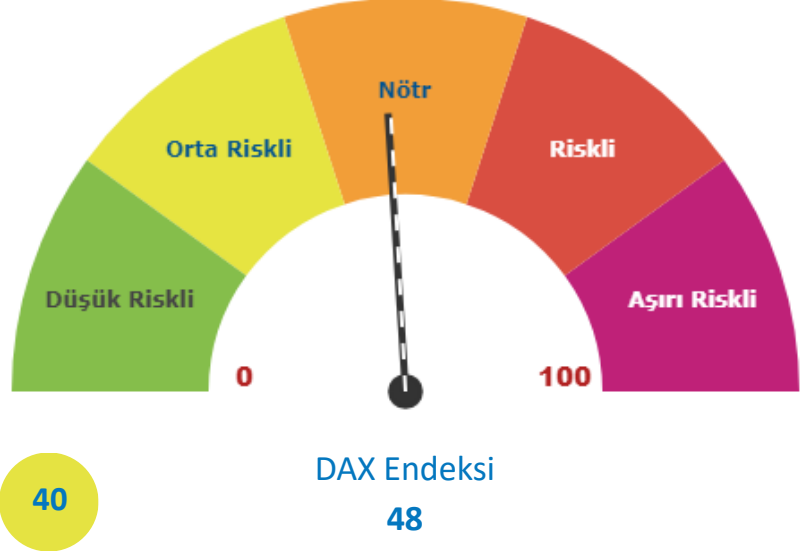


## DAX

Almanya Hisse Senedi modeli geçen hafta geçiş yaptığı **nötr** bölge içinde stabil konumunu korumaktadır.

Modelin orta riskli bölgeden nötr bölgeye geçtiği 1 aylık dönemde DAX Endeksi yaklaşık **%4.5 değer kaybı** yaşamıştır.

Bu hafta **48** Bir hafta önce **48** Bir ay önce **40**

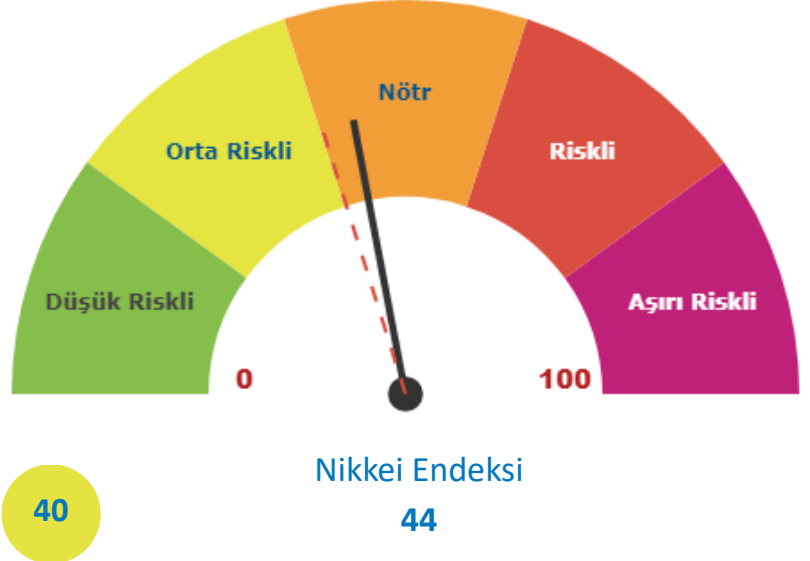


## NIKKEI

Japonya Hisse Senedi modeli geçtiğimiz hafta bulunduğu **orta riskli** bölge sınırından nötr bölgeye geçiş yapmıştır.

Aynı dönemde Nikkei Endeksinde yaklaşık **%1 değer kaybı** gözlenmiştir.

Bu hafta **44** Bir hafta önce **40** Bir ay önce **40**

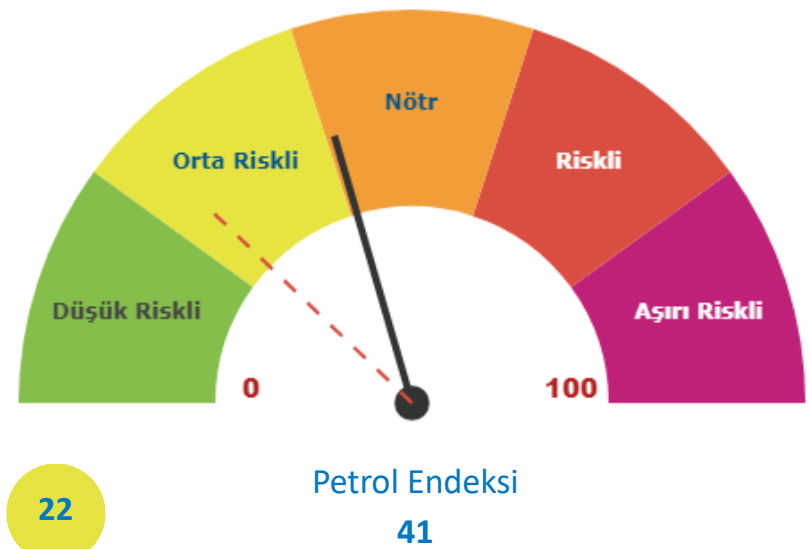


## PETROL

Petrol modeli 1 aydır bulunduğu orta riskli bölgeden **nötr** bölgeye geçiş yapmıştır.

Modelin bu hareketi esnasında Petrol fiyatları yaklaşık **%7 değer kaybetmiştir**.

Bu hafta **41** Bir hafta önce **24** Bir ay önce **22**



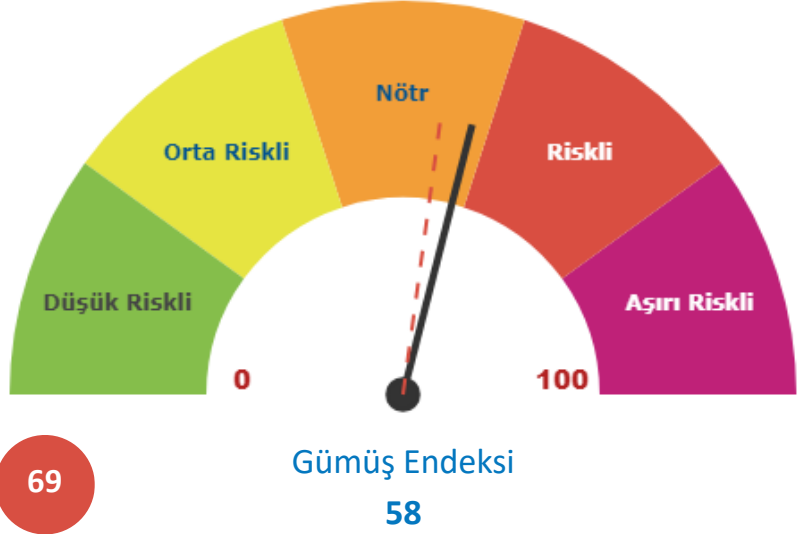
# RİSKOMETRE

## GÜMÜŞ

30 Ekim - 5 Kasım 2023

Son 2 haftadır **nötr** bölgede bulunan Gümüş modeli bu hafta aynı bölge içinde riskli yöne ilerlemiştir.

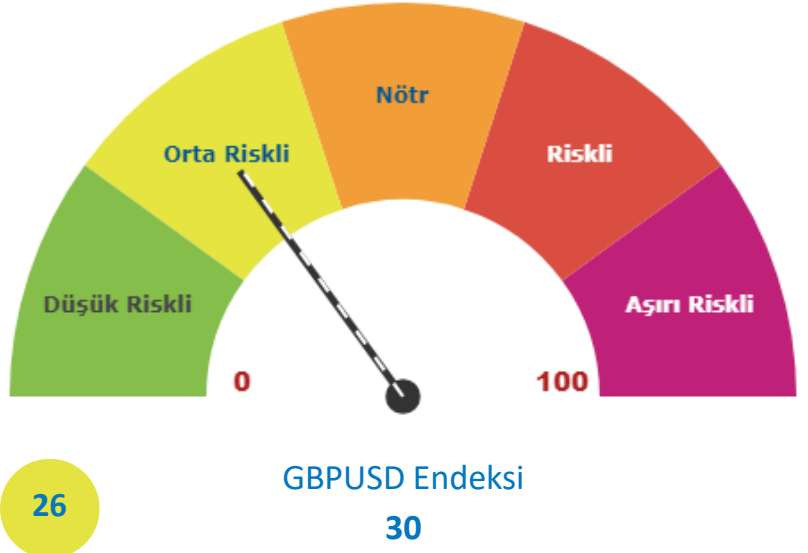
Gümüş fiyatları son 1 haftada yaklaşık **%2 değer kaybetmiştir.**



## GBPUSD

GBPUSD modeli 1 aydır **orta riskli** bölge içinde bulunmaya devam ediyor.

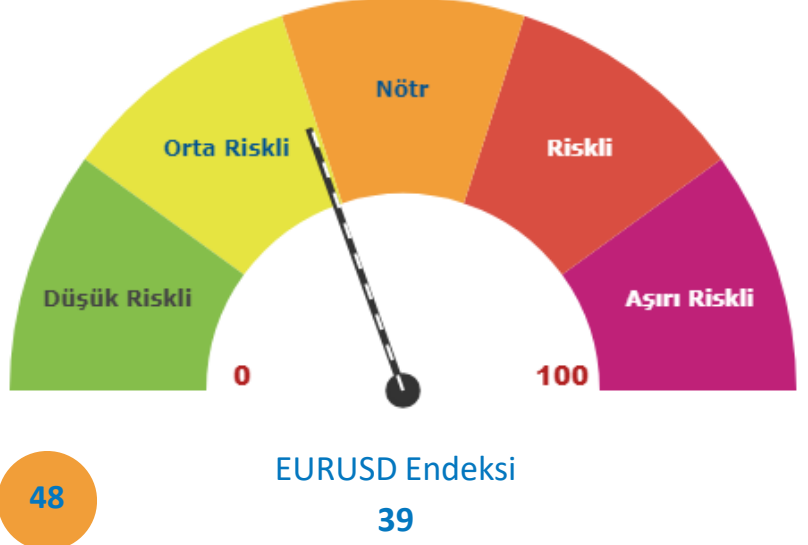
GBPUSD paritesi 1 ayda yaklaşık **%1 değer kaybetmiştir.**



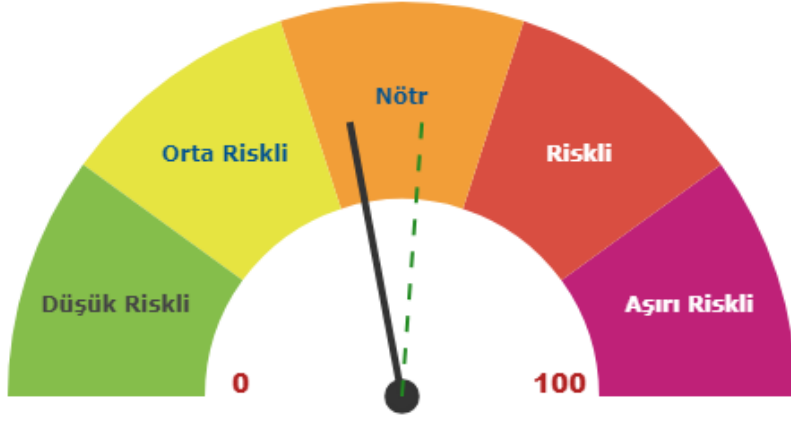
## EURUSD

EURUSD modeli 2 haftadır **orta riskli** bölge içinde bulunuyor.

Modelin 1 ayda nötr bölgeden orta riskli bölgeye geçişi ile EURUSD paritesinde yaklaşık **%1 değer kaybı** gözlenmiştir.



## 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 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."