

RİSKOMETRE

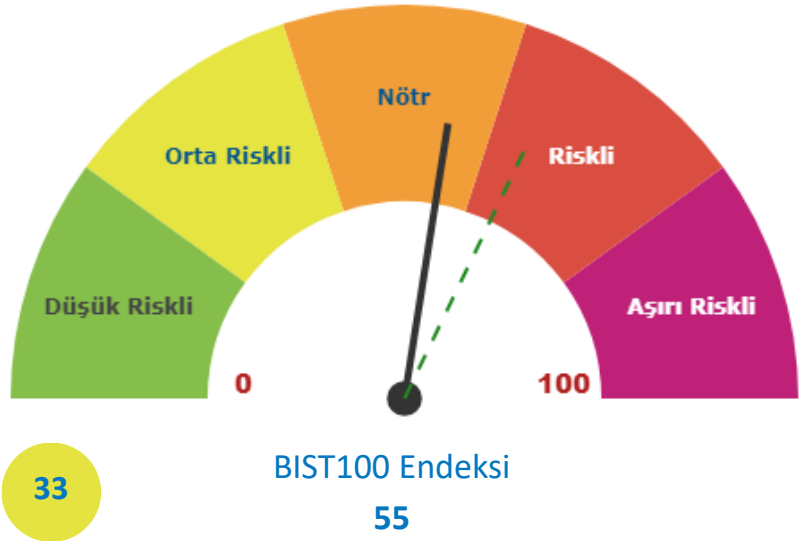
BIST100

6 - 12 Kasım 2023

Geçtiğimiz hafta riskli bölgeyi test eden BIST100 modeli düşük riskli yöne ilerleyerek **nötr** bölgeye geçiş yaptı.

Model 1 haftada düşük riskli yöne ilerlerken BIST100 Endeksinde **%3 getiri**, modelin 1 ayda riskli yöndeki hareketi ile aynı dönemde ise **%10 değer kaybı** gözlenmiştir.

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

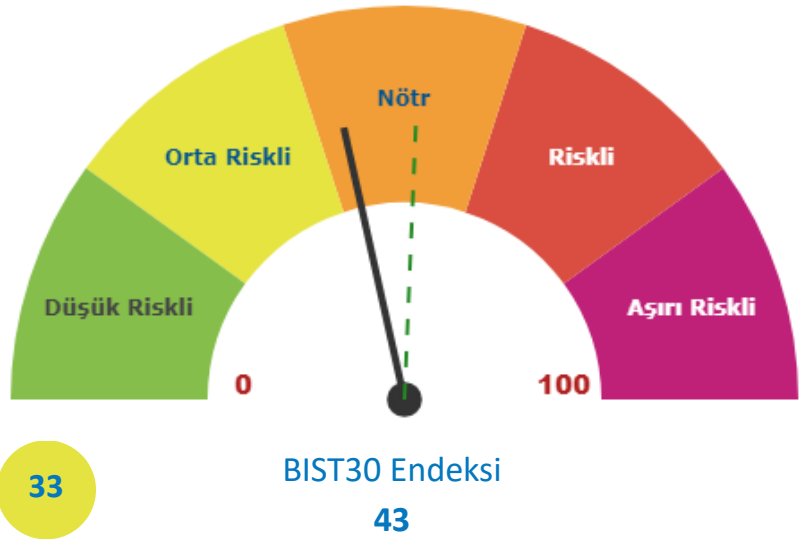


BIST30

BIST30 Modeli 1 ayda orta riskli bölgeden nötr bölgeye geçerken bu hafta **nötr** bölge içinde düşük riskli yönde ilerlemiştir.

Modelin 1 ayda orta riskli bölgeden nötr bölgeye geçişinde BIST30 Endeksi **%11 değer kaybetmiştir**.

Bu hafta **43** Bir hafta önce **51** Bir ay önce **33**

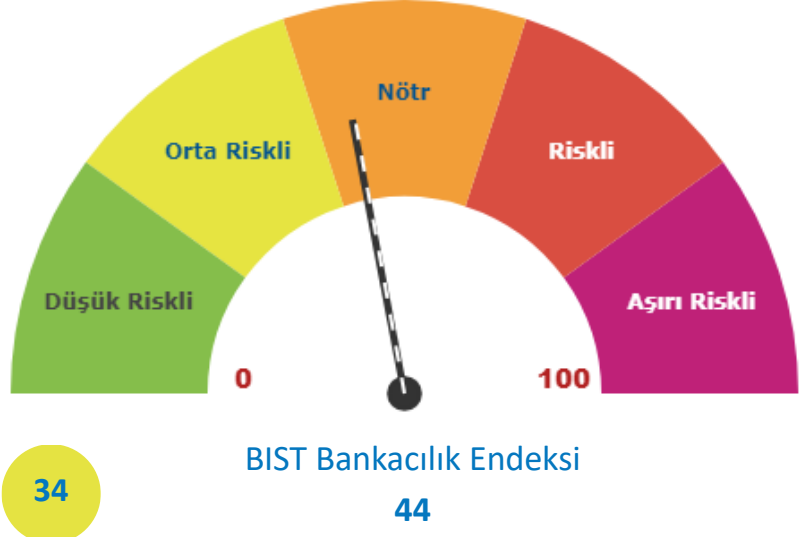


BIST BANKACILIK

Geçen hafta **nötr** bölgeye geçiş yapan Bist Bankacılık Modeli bu hafta da stabil konumunu korumaktadır.

Modelin 1 aylık riskli yöndeki hareketi esnasında BIST Bankacılık endeksi yaklaşık **%13 değer kaybetmiştir**.

Bu hafta **44** Bir hafta önce **44** Bir ay önce **34**

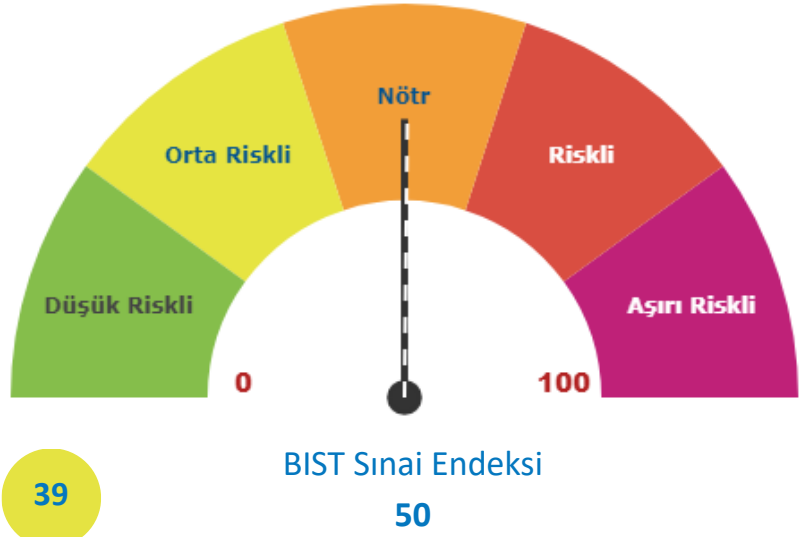


BIST SINAI

BIST Sınai Modeli 1 ay önce bulunduğu orta riskli bölgeden **nötr** bölgeye geçiş yapmış ve konumunu korumuştur.

Modelin 1 aylık hareketi ile aynı dönemde BIST Sınai endeksinde yaklaşık **%11 değer kaybı** gözlenmiştir.

Bu hafta **50** Bir hafta önce **50** Bir ay önce **39**

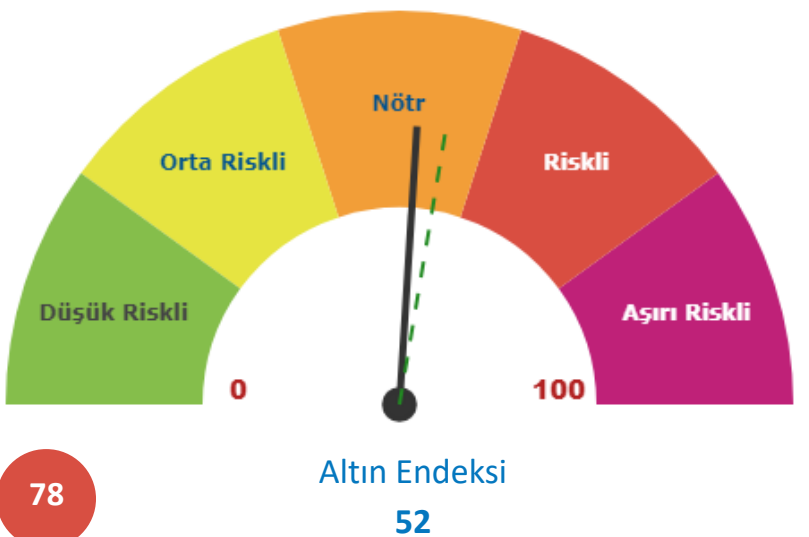


ALTIN

1 aylık dönemde bulunduğu riskli bölgeden düşük riskli yönde ilerlemeye devam eden Altın modeli bu hafta **nötr** bölge içinde yine düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin 1 aylık düşük riskli yönde hareketi ile aynı dönemde Altın fiyatları **%10 değer kazanmıştır**.

Bu hafta **52** Bir hafta önce **55** Bir ay önce **78**



RİSKOMETRE

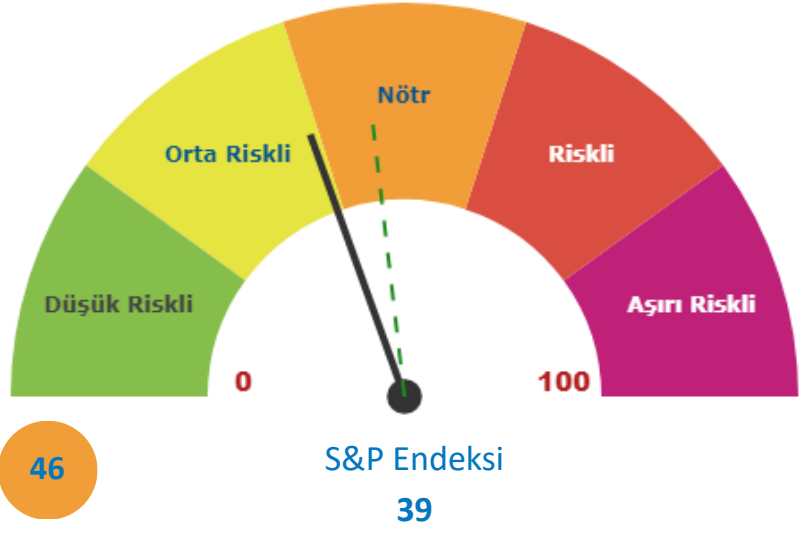
S&P

6 - 12 Kasım 2023

ABD Hisse Senedi modeli 1 aydır nötr bölge içinde yer alırken bu hafta **orta riskli** bölgeye geçiş yapmıştır.

Modelin 1 haftalık hareketi sırasında S&P Endeksi yaklaşık **%5 değer kazanmıştır.**

Bu hafta **39** Bir hafta önce **46** Bir ay önce **46**

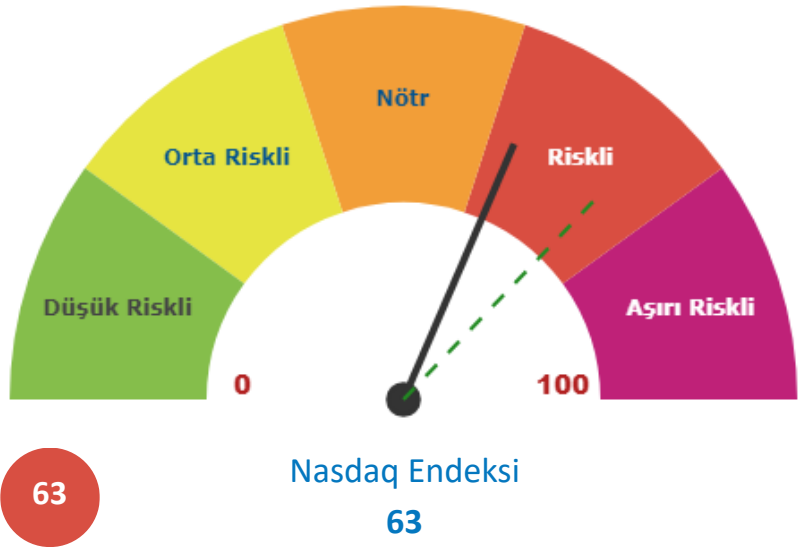


NASDAQ

1 aydır **riskli** bölge içinde dalgalı bir hareket sergileyen Nasdaq modeli bu hafta düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Model ile aynı dönemde Nasdaq Endeksi 1 haftada yaklaşık **%6 getiri sağlamıştır.**

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

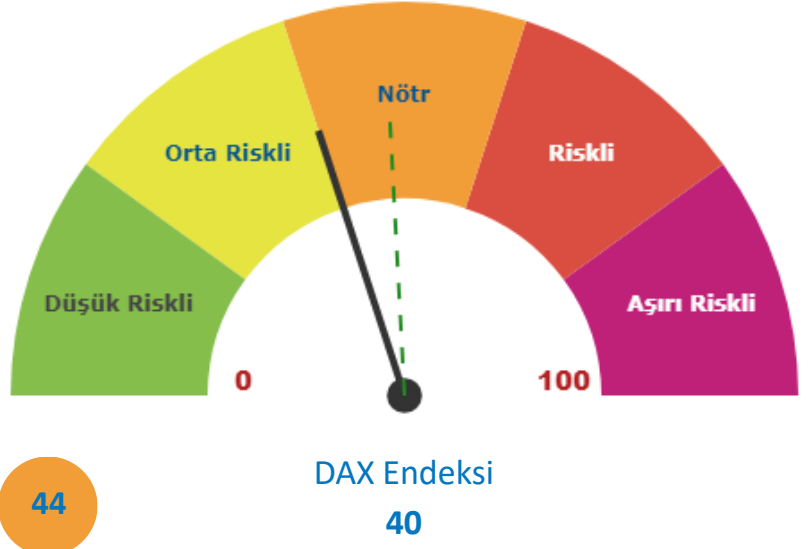


DAX

Almanya Hisse Senedi modeli bu hafta nötr bölgeden **orta riskli** bölge sınırına geçiş yapmıştır.

Modelin bu hareketi ile aynı dönemde DAX Endeksi yaklaşık **%3.5 değer kazanmıştır.**

Bu hafta **40** Bir hafta önce **48** Bir ay önce **44**

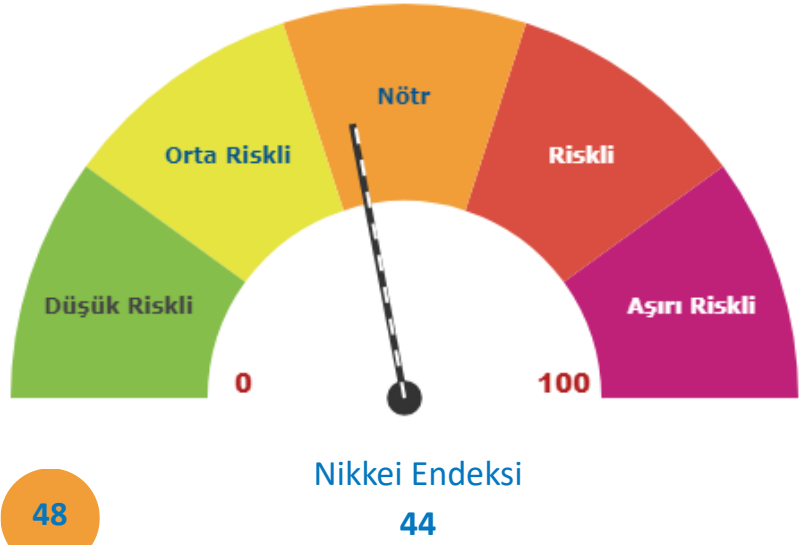


NIKKEI

Japonya Hisse Senedi modeli bu hafta **nötr** bölge içinde stabil kalırken 1 ayda düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin 1 aylık hareketi ile aynı dönemde Nikkei Endeksinde yaklaşık **%3.5 getiri gözlenmiştir.**

Bu hafta **44** Bir hafta önce **44** Bir ay önce **48**

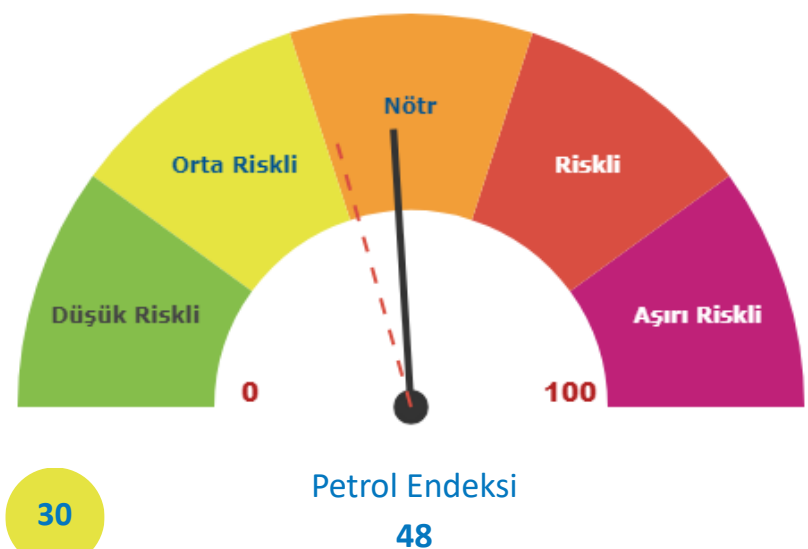


PETROL

Geçtiğimiz hafta **nötr** bölgeye geçiş yapan Petrol modeli bu hafta da aynı bölgede riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin bu hareketi esnasında Petrol fiyatları yaklaşık **%3.5 değer kaybetmiştir.**

Bu hafta **48** Bir hafta önce **41** Bir ay önce **30**



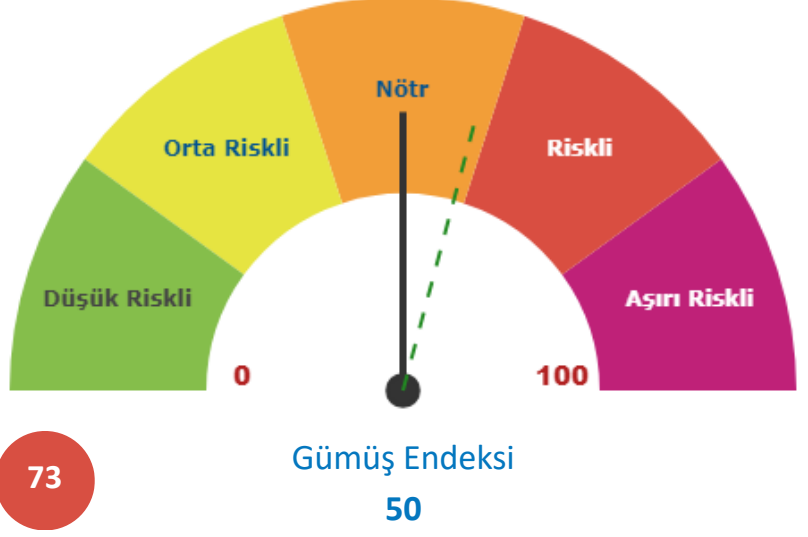
RİSKOMETRE

GÜMÜŞ

6 - 12 Kasım 2023

1 ay önce bulunduğu riskli bölgeden **nötr** bölgeye geçiş yapan Gümüş modeli bu hafta da düşük riskli yönde hareketini sürdürmüştür.

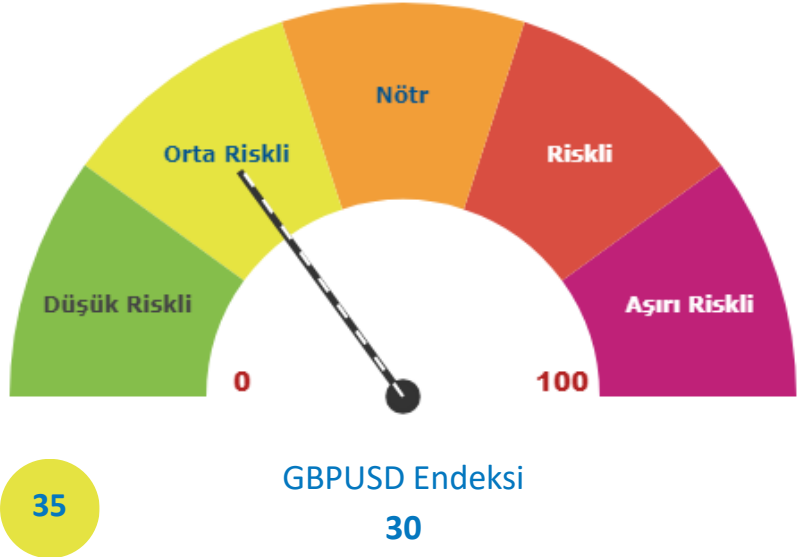
Gümüş fiyatları 1 ayda yaklaşık **%8** değer kazanmıştır.



GBPUSD

GBPUSD modeli 1 aylık dönemde **orta riskli** bölge içinde düşük riskli ilerlerken bu hafta stabil kalmıştır.

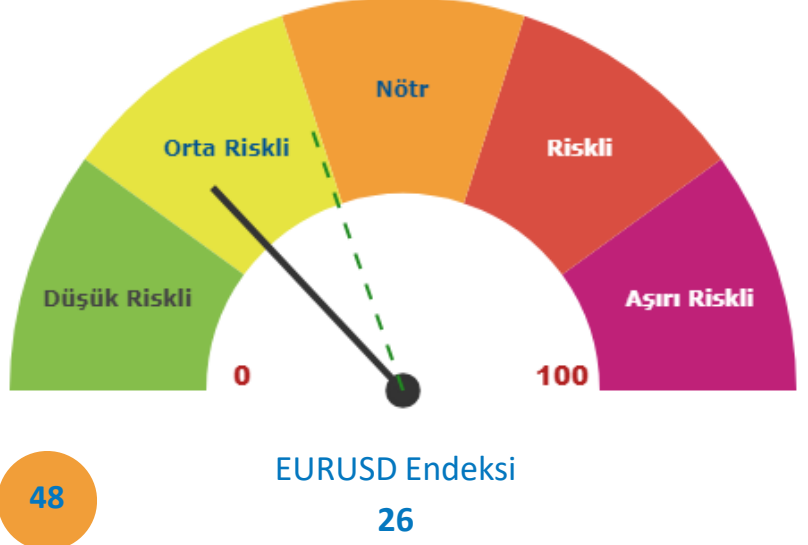
GBPUSD paritesi 1 ayda yaklaşık **%7** değer kazanmıştır.



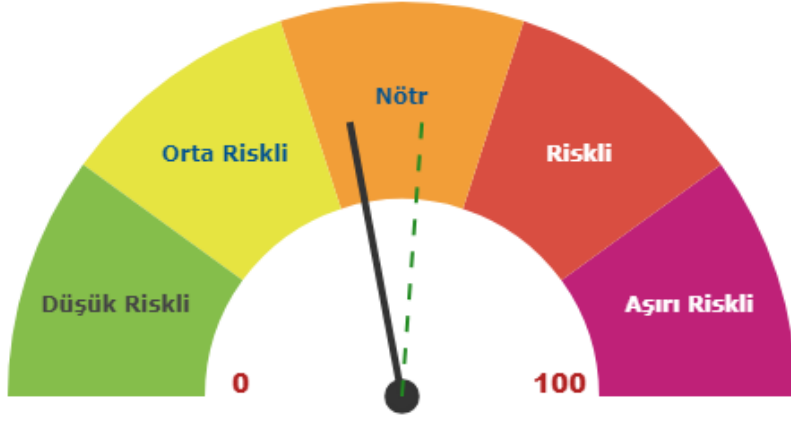
EURUSD

EURUSD modeli 1 ay önce bulunduğu nötr bölgeden **orta riskli** bölgeye geçmiş ve bu hafta da düşük riskli yönde hareketini sürdürmüştür.

Modelin düşük riskli yönde hareketi ile aynı dönemde 1 haftada EURUSD paritesinde yaklaşık **%1**, 1 ayda ise **%2** getiri 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

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."