

# RİSKOMETRE

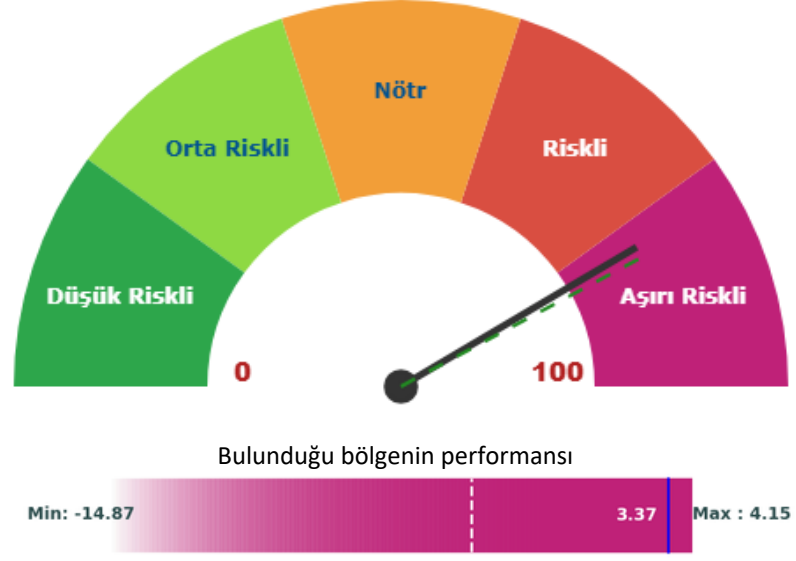
BIST100

11 - 17 Kasım 2024

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

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

Bu hafta **83** Bir hafta önce **84** Bir ay önce **67**

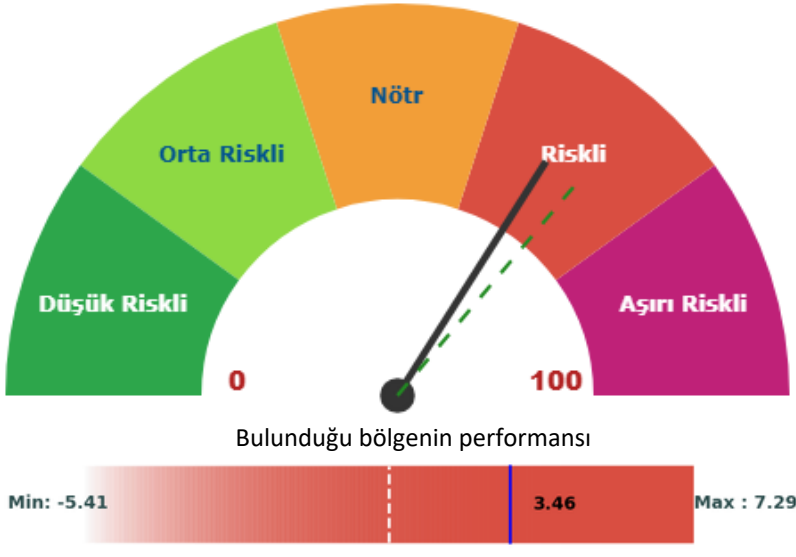


## BIST TEKNOLOJİ

BIST Teknoloji Modeli bu hafta **riskli bölge** içinde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda BIST Teknoloji Endeksi yaklaşık **%11 değer kazanmıştır**. BIST Teknoloji Endeksi performansı riskli bölgeye girdiğinden beri **bu bölgedeki tarihsel ortalamasının üzerindedir**.

Bu hafta **68** Bir hafta önce **72** Bir ay önce **99**

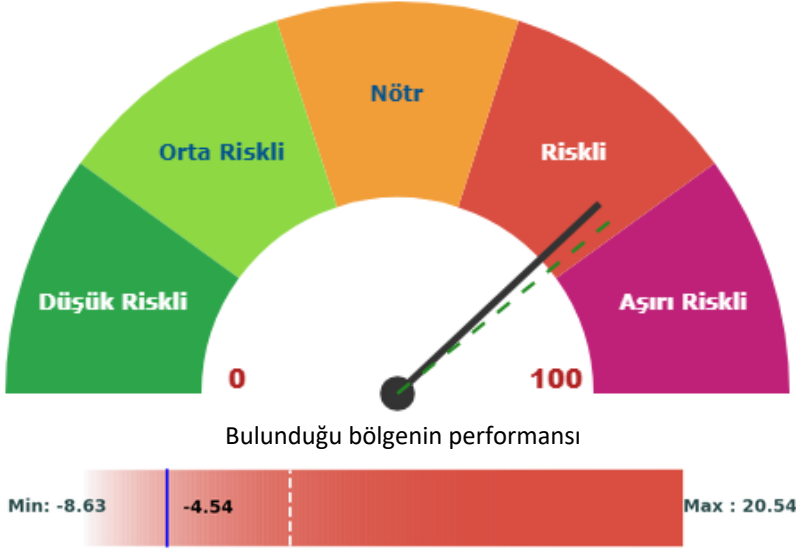


## BIST BANKACILIK

BIST Bankacılık modeli 1 aylık dönemde riskli yöne ilerlerken bu hafta **riskli bölgede** düşük riskli yöne ilerlemiştir.

BIST Bankacılık Endeksi, modelin riskli yöne ilerlediği 1 ayda **yaklaşık %10 değer kaybetmiştir**. Model bu bölgeye girdiğinden beri BIST Bankacılık Endeksi performansı bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında yer almaktadır**.

Bu hafta **76** Bir hafta önce **78** Bir ay önce **54**

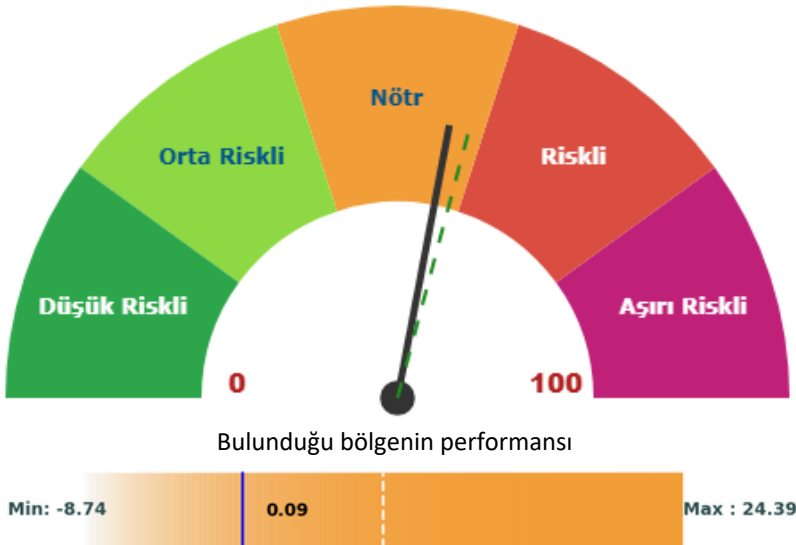


## BIST SINAI

BIST Sınai modeli bu hafta, geçen hafta geçiş yaptığı **nötr bölge** içinde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

BIST Sınai Endeksi, modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda yaklaşık **%3.5 değer kazanmıştır**. Model nötr bölgeye girdiğinden beri BIST Sınai Endeksi performansı bu bölgedeki tarihsel **ortalamasının altında seyretmektedir**.

Bu hafta **56** Bir hafta önce **58** Bir ay önce **65**

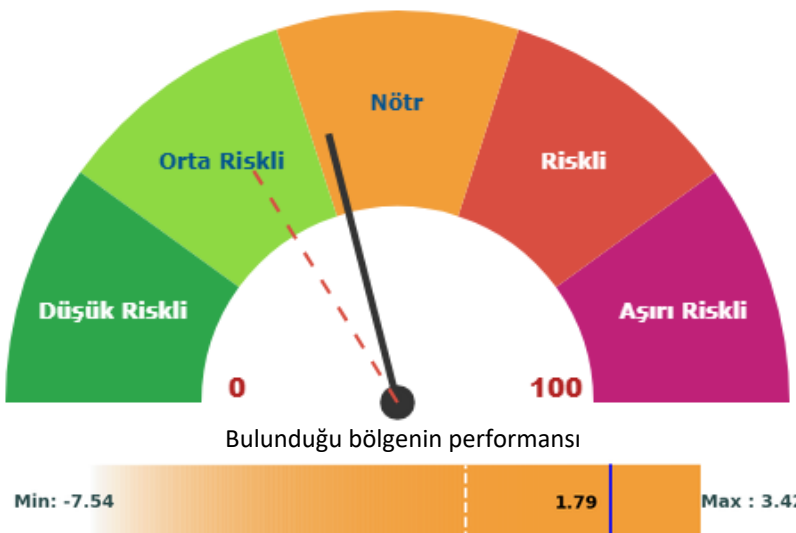


## ALTIN

Altın Modeli 1 aylık dönemde riskli yöne ilerleyerek orta riskli bölgeden **nötr bölgeye** geçiş yapmıştır.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftada Altın fiyatları **yaklaşık %1.5 değer kaybetmiştir**. Model nötr bölgeye girdiğinden beri Altın getirisi bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde yer almaktadır**.

Bu hafta **42** Bir hafta önce **32** Bir ay önce **32**



# RİSKOMETRE

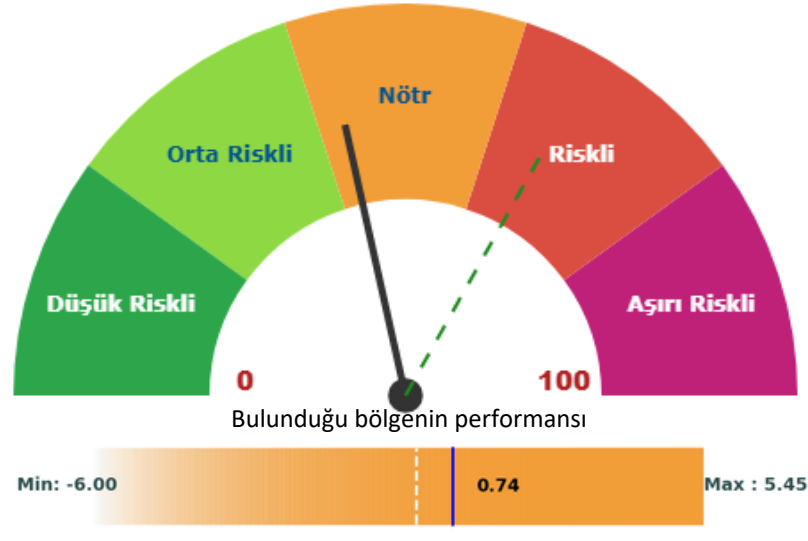
S&P

11 - 17 Kasım 2024

ABD Hisse Senedi modeli bu hafta riskli bölgeden **nötr bölgeye** dönüş yapmıştır.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada S&P Endeksi yaklaşık **%5 değer kazanmıştır**. Model nötr bölgeye girdiğinden beri S&P Endeksinin performansı, bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır**.

Bu hafta **45** Bir hafta önce **63** Bir ay önce **56**

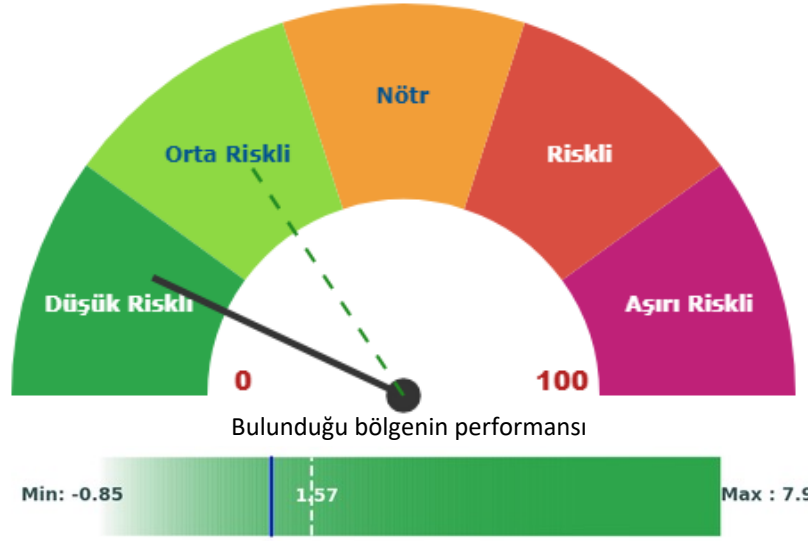


## NASDAQ

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

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada endeks yaklaşık **%6 değer kazanmıştır**. Model orta riskli bölgeye girdiğinden beri endeksin getirisi bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında yer almaktadır**.

Bu hafta **14** Bir hafta önce **31** Bir ay önce **24**

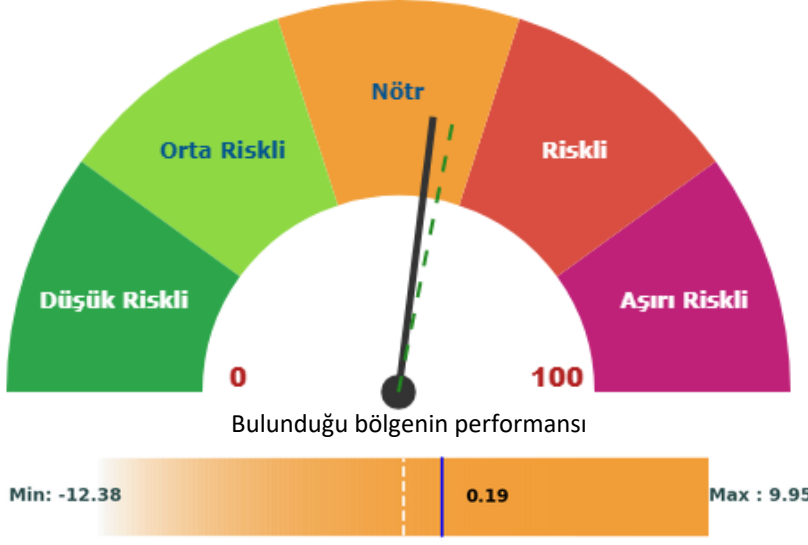


## DAX

1 haftalık dönemde **nötr bölge** içinde düşük riskli yöne ilerleyen Almanya Hisse Senedi modeli 1 ayda riskli yöne ilerlemiştir.

DAX Endeksi, modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada yaklaşık **%1.5 değer kazanmıştır**. DAX Endeksi performansı nötr bölgeye girdiğinden beri bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır**.

Bu hafta **54** Bir hafta önce **56** Bir ay önce **52**

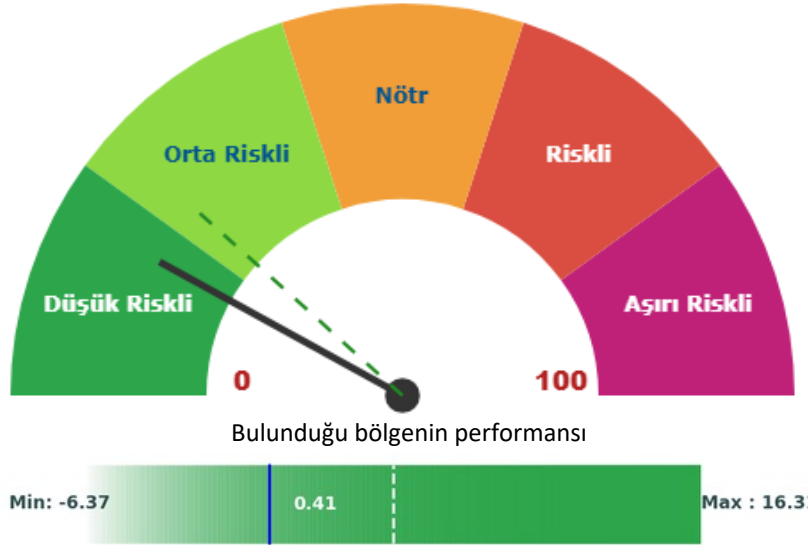


## NIKKEI

Japonya Hisse Senedi modeli bu hafta orta riskli bölgeden **düşük riskli bölgeye** geçmiştir.

Nikkei Endeksi, modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada yaklaşık **%4 değer kazanmıştır**. Nikkei Endeksinin getirisi düşük riskli bölgeye girdiğinden beri bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında bulunmaktadır**.

Bu hafta **16** Bir hafta önce **23** Bir ay önce **28**

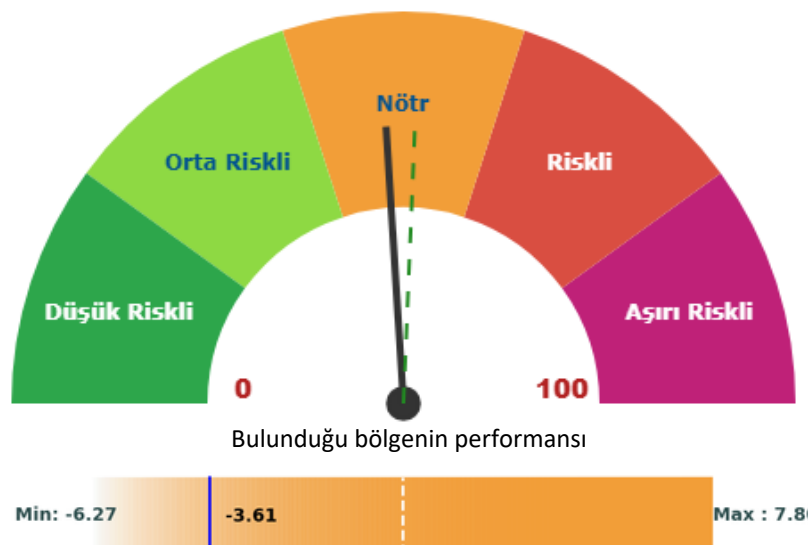


## PETROL

1 haftalık dönemde **nötr bölge** içinde düşük riskli yöne ilerleyen Petrol modeli 1 ayda riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 ayda Petrol fiyatları yaklaşık **%6 değer kaybetmiştir**. Model nötr bölgeye girdiğinden beri petrolün getirisi nötr bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında bulunmaktadır**.

Bu hafta **48** Bir hafta önce **51** Bir ay önce **43**



# RİSKOMETRE

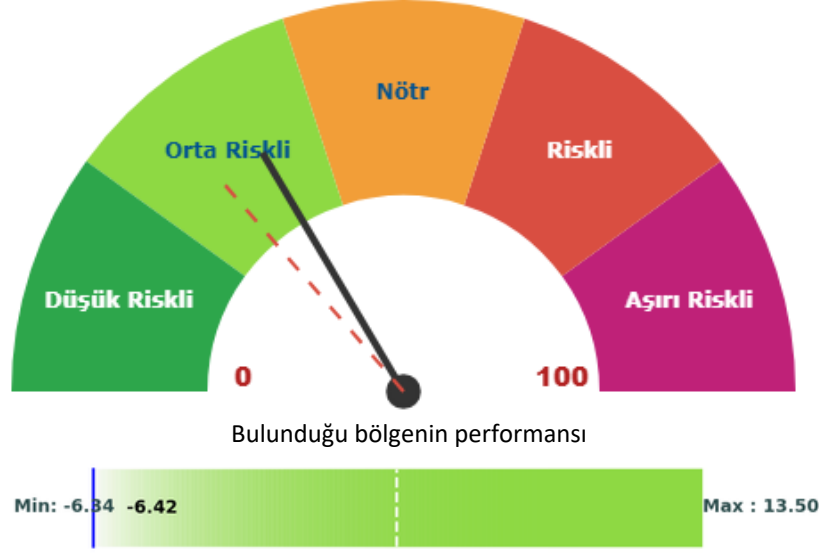
## GÜMÜŞ

11 - 17 Kasım 2024

Gümüş modeli 1 haftalık dönemde **orta riskli bölge** içinde riskli yöne ilerleyerek 1 ay önceki konumuna dönüş yapmıştır.

Gümüş fiyatları, modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftada yaklaşık **%3 değer kaybetmiştir**. Gümüşün getirisi bu bölgedeki **tarihsel minimum değerinin altında bulunmaktadır**.

Bu hafta **33** Bir hafta önce **26** Bir ay önce **33**

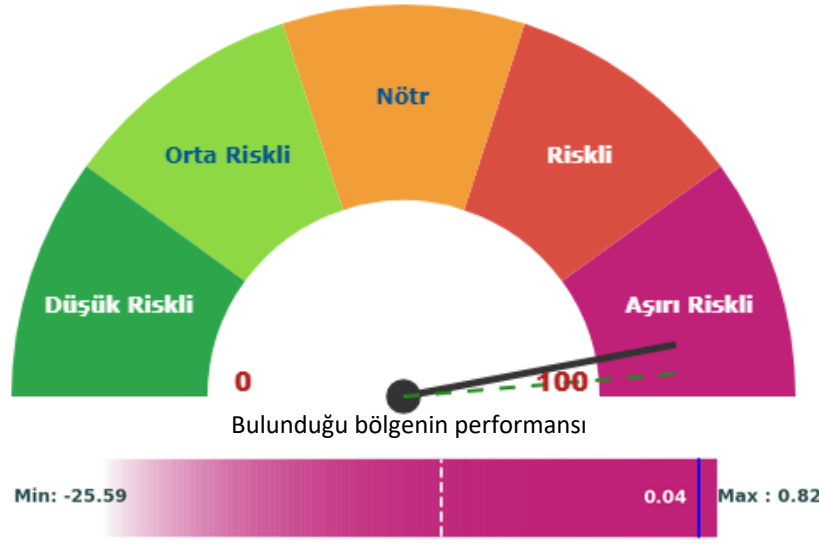


## GBPUSD

GBPUSD modeli 1 aylık dönemde aşırı riskli yöne ilerlerken bu hafta **aşırı riskli bölge** içinde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

GBPUSD paritesi, modelin aşırı riskli yöne ilerlediği 1 ayda yaklaşık **%1 değer kaybetmiştir**. GBPUSD parite getirisi bu bölgeye girdiğinden beri bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde yer almaktadır**.

Bu hafta **94** Bir hafta önce **97** Bir ay önce **68**

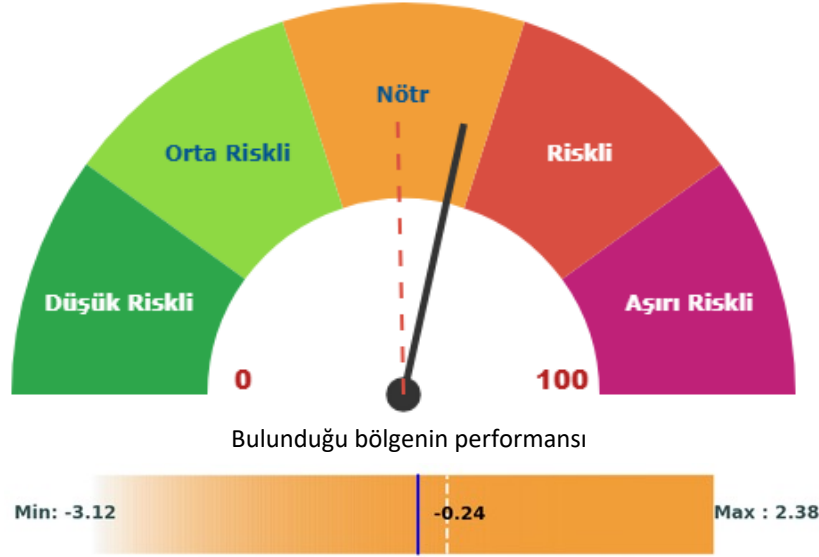


## EURUSD

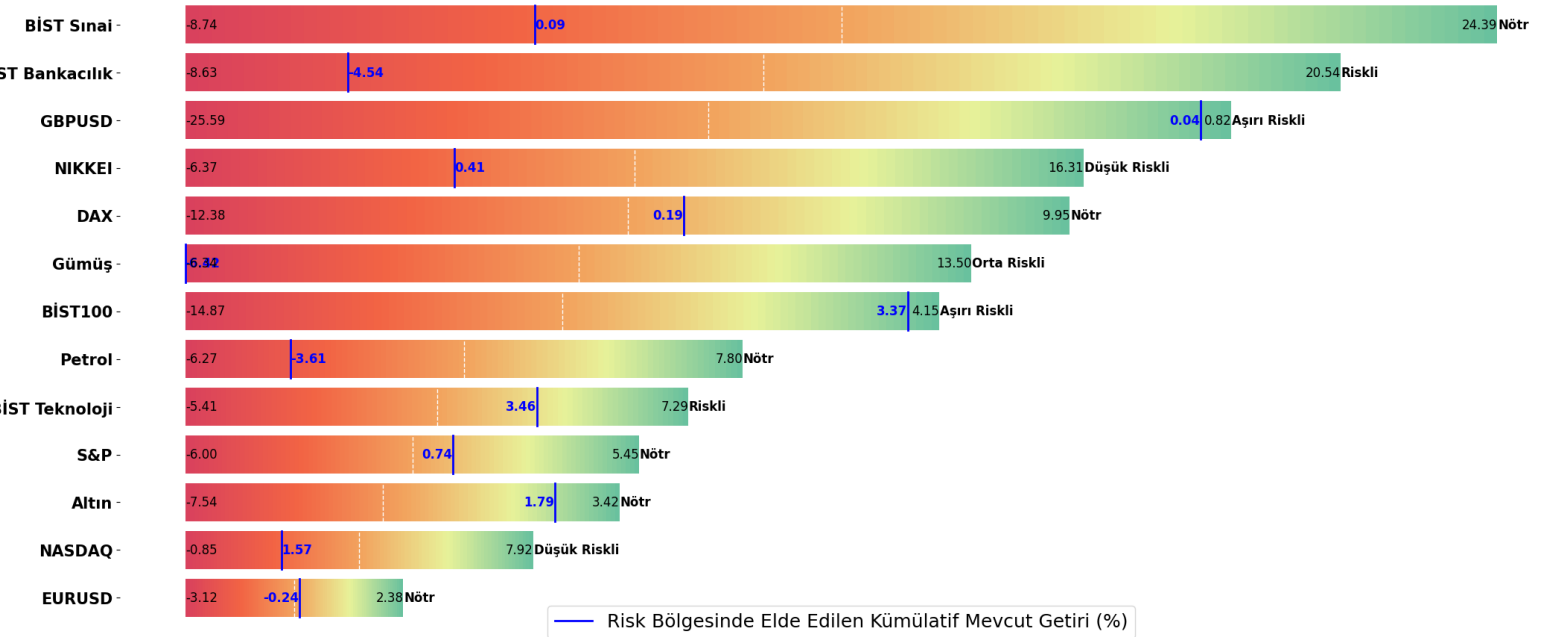
1 aylık dönemde **nötr bölgede** yer alan EURUSD modeli bu hafta riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftalık dönemde EURUSD paritesi yaklaşık **%1 değer kaybı yaşamıştır**. EURUSD paritesi performansı nötr bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında bulunmaktadır**.

Bu hafta **57** Bir hafta önce **49** Bir ay önce **58**

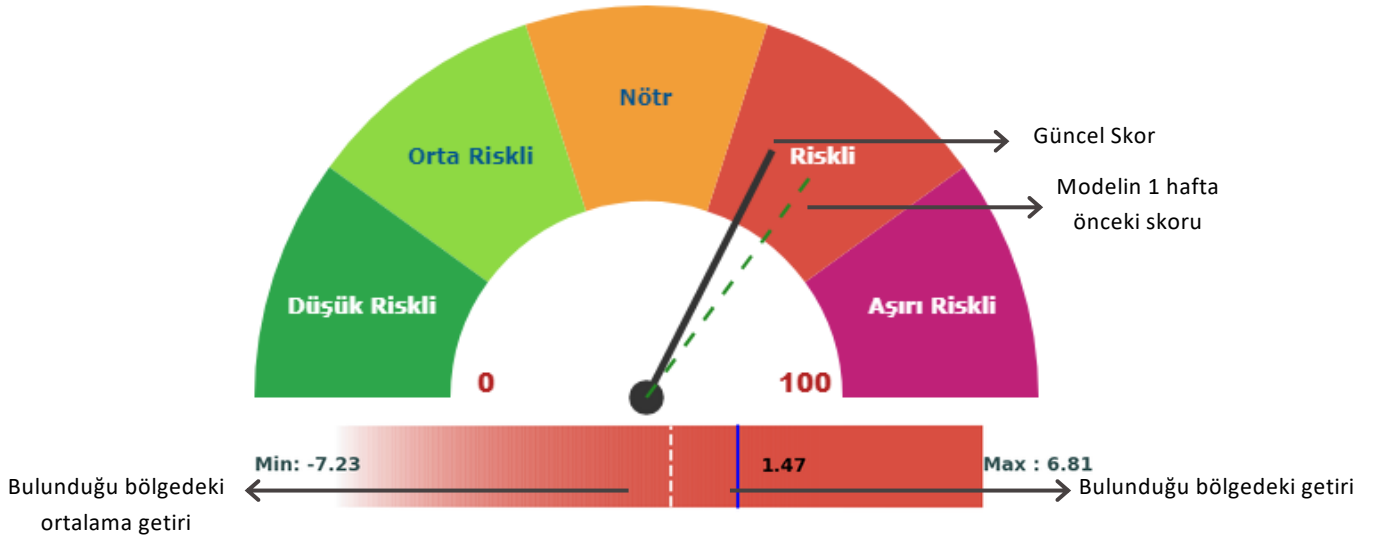


## Bulunduğu Bölgeye Göre Getiri Bantları



\*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](http://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."