

# RİSKOMETRE

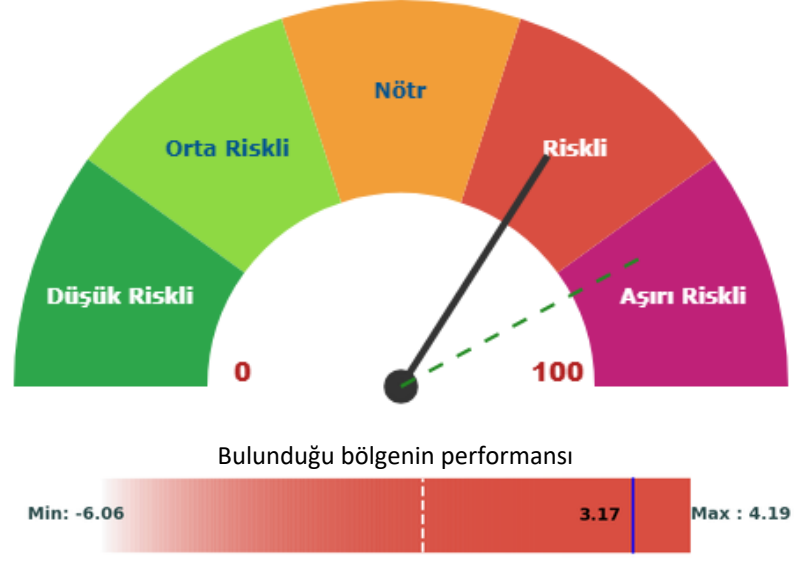
BIST100

18 - 24 Kasım 2024

Geçen hafta aşırı riskli bölgeyi test eden BIST100 Modeli, 1 aylık dönemde **riskli bölge** içinde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

BIST100 Endeksi, modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda **yaklaşık %7 değer kazanmıştır**. Model bu bölgeye girdiğinden beri BIST100 Endeksi performansı, bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır**.

Bu hafta **69** Bir hafta önce **84** Bir ay önce **78**

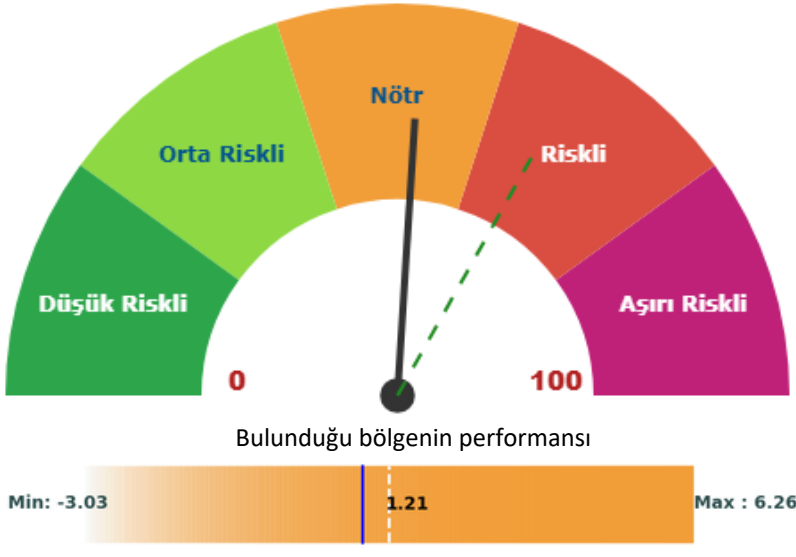


## BIST TEKNOLOJİ

1 aylık dönemde dalgalı seyreden BIST Teknoloji Modeli bu hafta riskli bölgeden **nötr bölgeye** geçiş yapmıştır.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda BIST Teknoloji Endeksi yaklaşık **%10 değer kazanmıştır**. BIST Teknoloji Endeksi performansı nötr bölgeye girdiğinden beri **bu bölgedeki tarihsel ortalamasının altındadır**.

Bu hafta **52** Bir hafta önce **66** Bir ay önce **82**

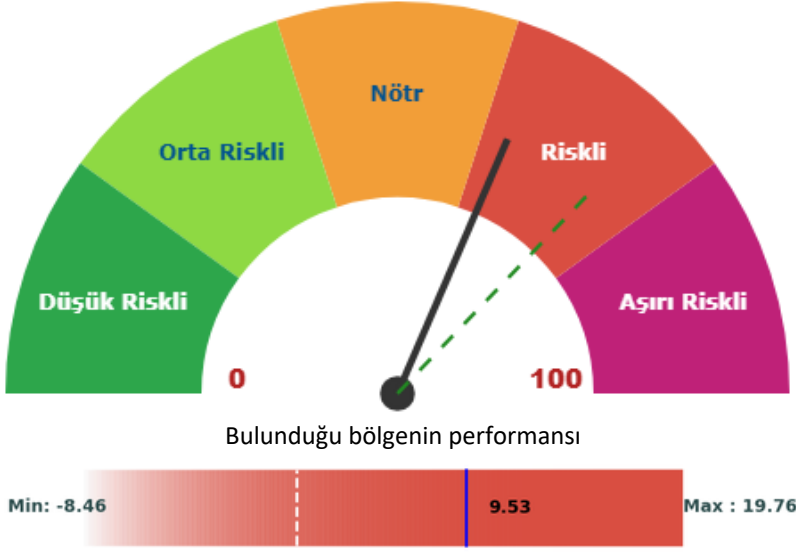


## BIST BANKACILIK

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

BIST Bankacılık Endeksi, modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada **yaklaşık %8 getiri sağlamıştır**. Model riskli bölgeye girdiğinden beri BIST Bankacılık Endeksi performansı bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde yer almaktadır**.

Bu hafta **63** Bir hafta önce **74** Bir ay önce **62**

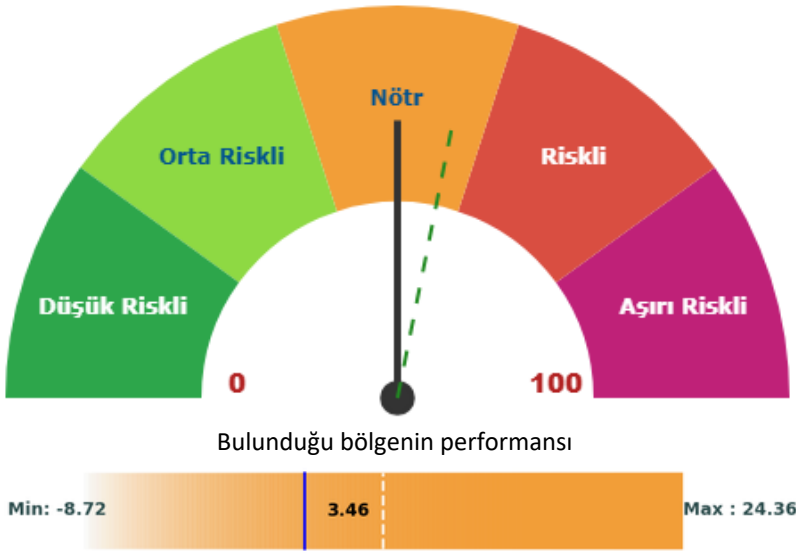


## BIST SINAI

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

BIST Sınai Endeksi, modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda yaklaşık **%5.5 değer kazanmıştır**. Model nötr bölgeye girdiğinden beri BIST Sınai Endeksi performansı bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında seyretmektedir**.

Bu hafta **50** Bir hafta önce **56** Bir ay önce **64**

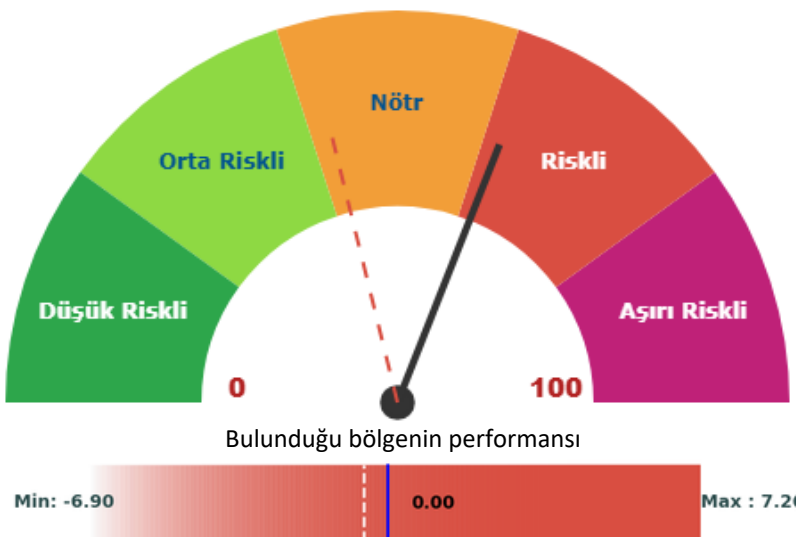


## ALTIN

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

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftada Altın fiyatları **yaklaşık %4.5 değer kaybetmiştir**. Model bu bölgeye girdiğinden beri Altın getirisi bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde yer almaktadır**.

Bu hafta **62** Bir hafta önce **42** Bir ay önce **22**



# RİSKOMETRE

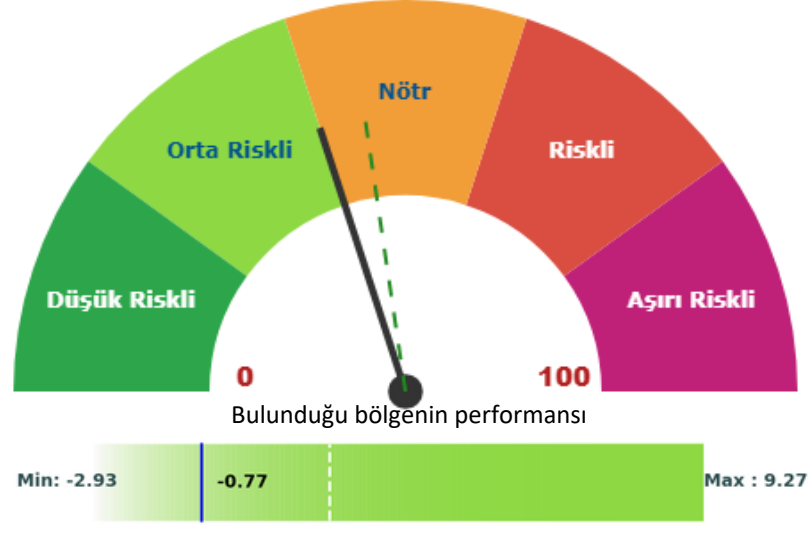
S&P

18 - 24 Kasım 2024

ABD Hisse Senedi modeli 1 aylık dönemde düşük riskli yöne ilerlemiş ve bu hafta nötr bölgeden **orta riskli bölgeye** geçiş yapmıştır.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda S&P Endeksi yaklaşık **%2 değer kazanmıştır**. Model nötr bölgeye girdiğinden beri S&P Endeksinin performansı, bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında bulunmaktadır**.

Bu hafta **40** Bir hafta önce **45** Bir ay önce **49**

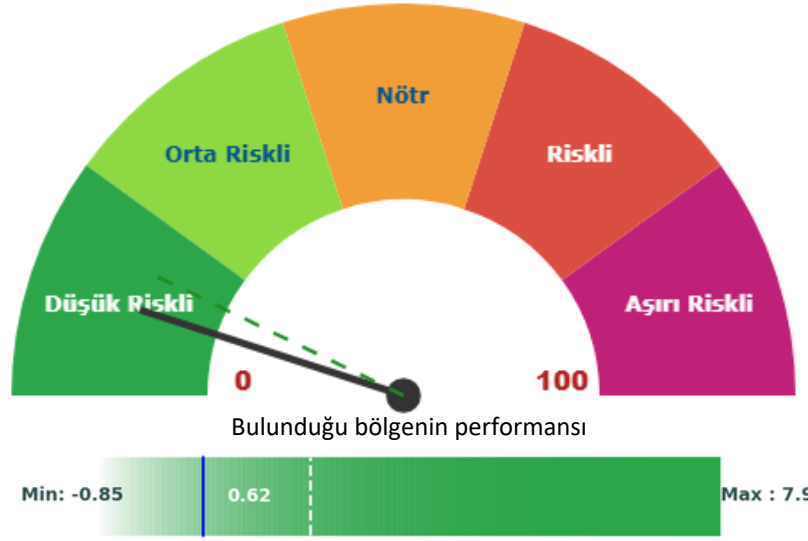


## NASDAQ

NASDAQ modeli 1 aylık dönemde **düşük riskli bölge** içinde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda endeks yaklaşık **%4 değer kazanmıştır**. Model düşük riskli bölgeye girdiğinden beri endeksin getirisi bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında yer almaktadır**.

Bu hafta **10** Bir hafta önce **14** Bir ay önce **21**

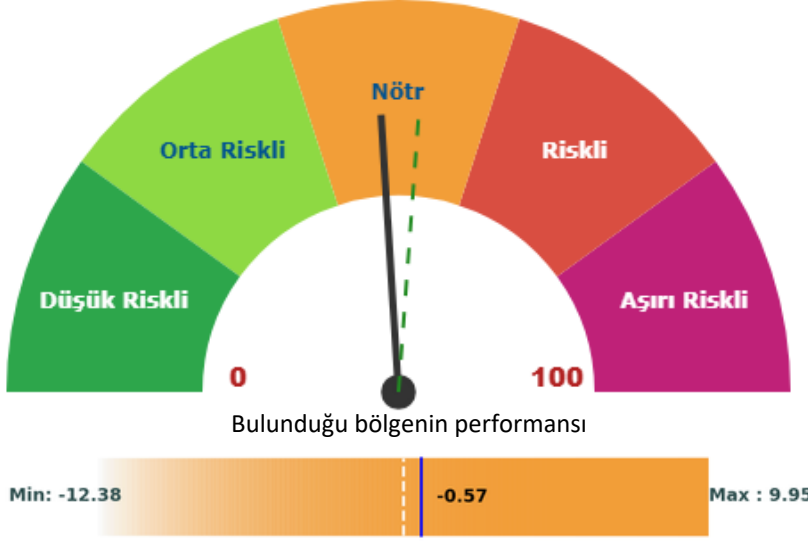


## DAX

Almanya Hisse Senedi modeli 1 aylık dönemde **nötr bölge** içinde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

DAX Endeksi modelin nötr sinyal verdiği 1 aylık dönemde yaklaşık **%3 değer kaybetmiştir**. DAX Endeksi performansı nötr bölgeye girdiğinden beri bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır**.

Bu hafta **48** Bir hafta önce **52** Bir ay önce **50**

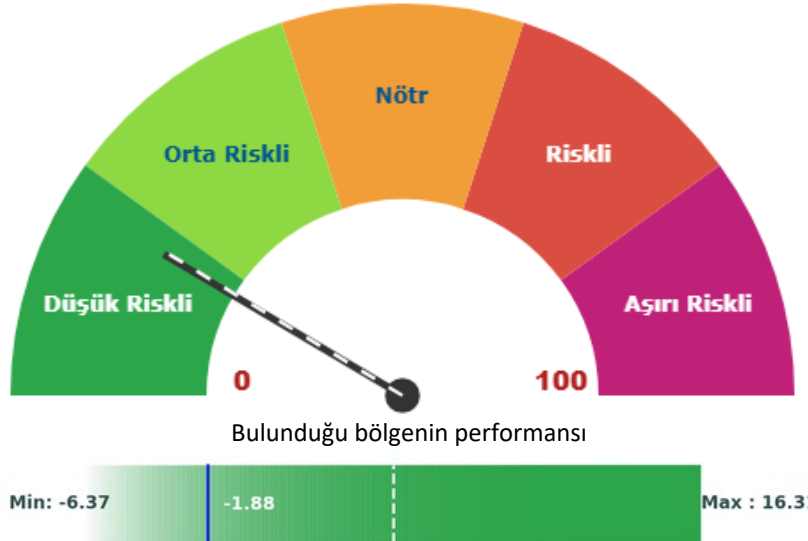


## NIKKEI

Japonya Hisse Senedi modeli bu hafta **düşük riskli bölge** içinde konumunu korumuştur.

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

Bu hafta **17** Bir hafta önce **17** Bir ay önce **22**

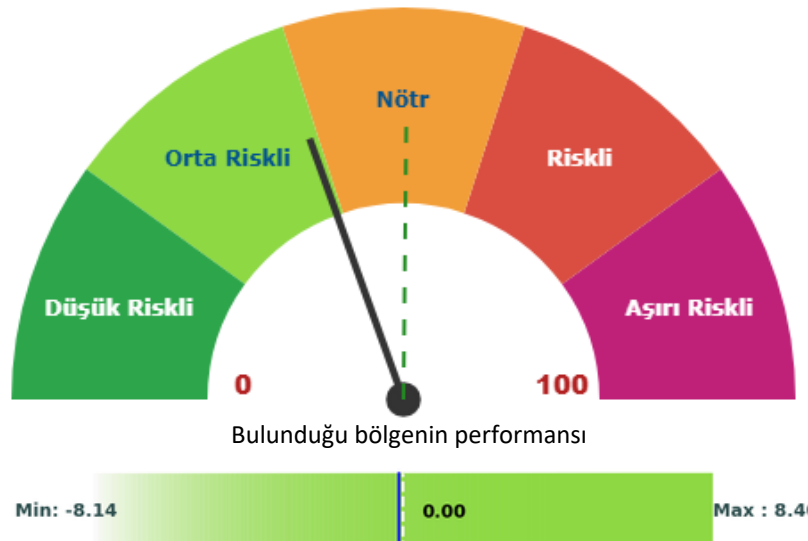


## PETROL

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

Modelin düşük riskli yöne ilerlemesine rağmen Petrol fiyatları 1 ayda **yaklaşık %2 değer kaybetmiştir**. Model orta riskli bölgeye girdiğinden beri petrolün getirisi bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının yakınında bulunmaktadır**.

Bu hafta **39** Bir hafta önce **50** Bir ay önce **58**



# RİSKOMETRE

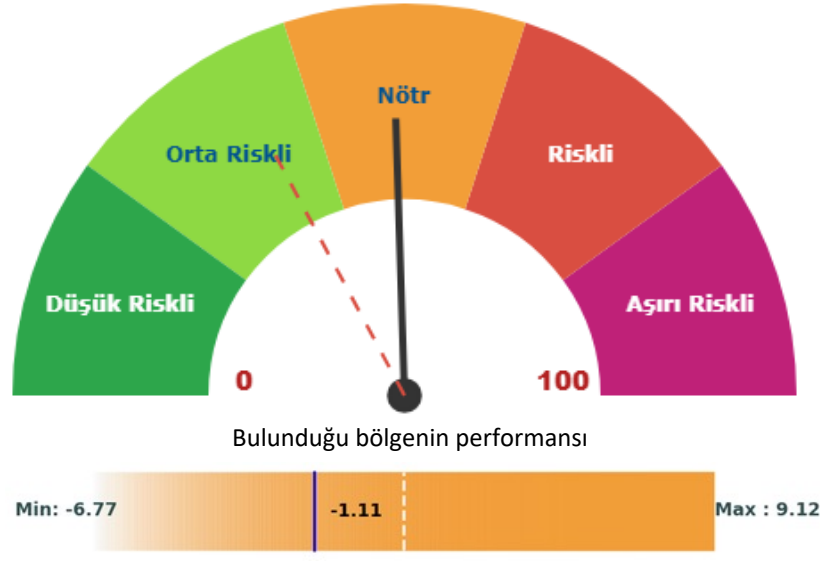
## GÜMÜŞ

18 - 24 Kasım 2024

Gümüş modeli bu hafta riskli yöne ilerleyerek **nötr bölgeye** geçiş yapmıştır.

Model 1 ayda riskli yöne ilerlerken Gümüş **yaklaşık %10 kayıp yaşamıştır**. Gümüşün getiri performansı bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında** bulunmaktadır.

Bu hafta **49** Bir hafta önce **34** Bir ay önce **28**

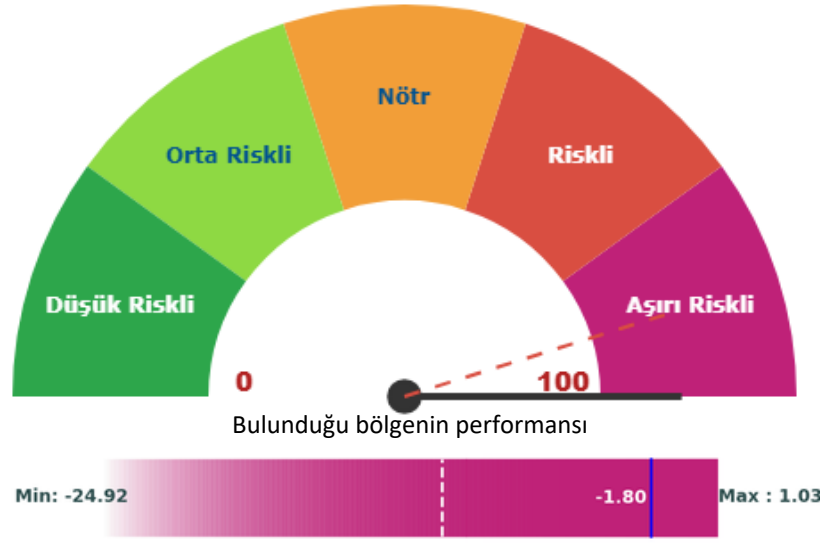


## GBPUSD

GBPUSD modeli 1 aylık dönemde aşırı riskli yöne ilerleyerek bu hafta **aşırı riskli bölge** içinde maksimum risk değerine ulaşmıştır.

GBPUSD paritesi, modelin aşırı riskli yöne ilerlediği 1 ayda yaklaşık **%3 değer kaybetmiştir**. GBPUSD parite getirisi bu bölgeye girdiğinden beri bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde** yer almaktadır.

Bu hafta **100** Bir hafta önce **90** Bir ay önce **52**

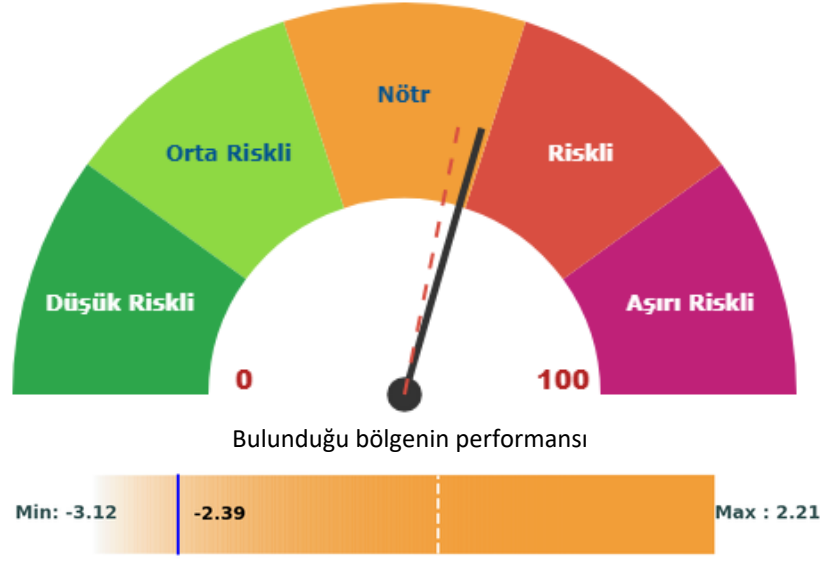


## EURUSD

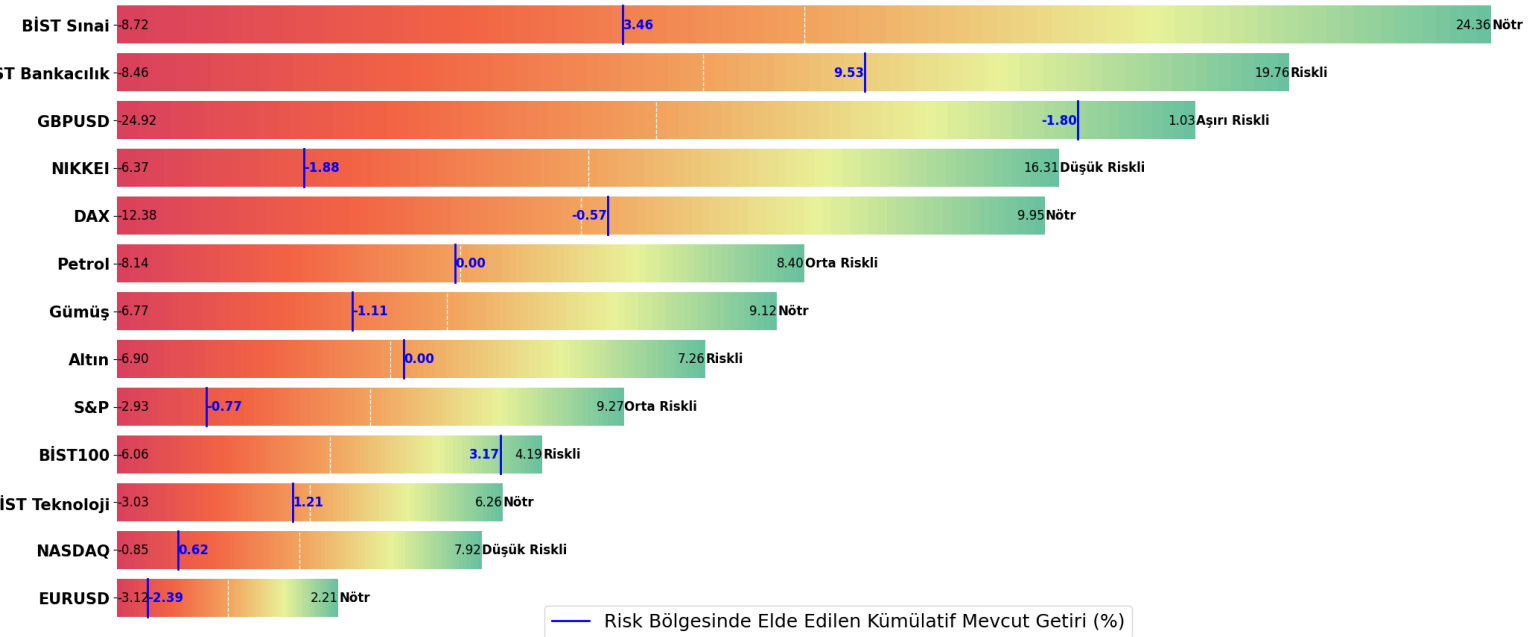
EURUSD modeli 1 haftalık ve 1 aylık dönemde **nötr bölge** içinde riskli yöne ilerlemiştir.

Model 1 ayda riskli yöne ilerlerken EURUSD paritesi yaklaşık **%3 değer kaybı yaşamıştır**. EURUSD paritesi performansı nötr bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında** bulunmaktadır.

Bu hafta **59** Bir hafta önce **56** Bir ay önce **55**

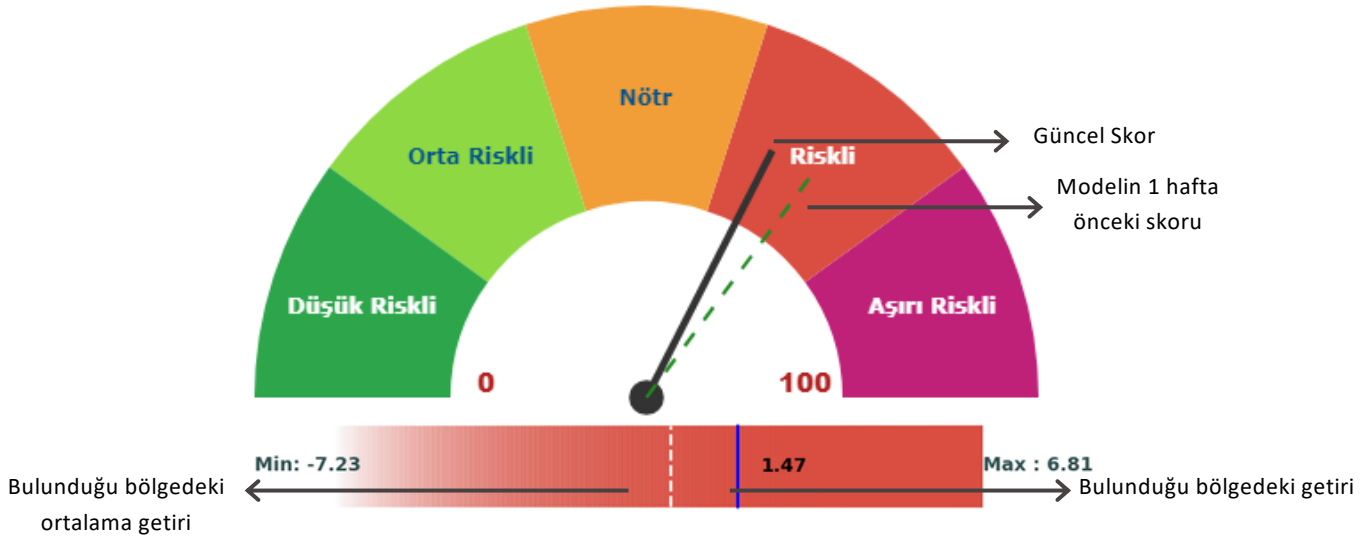


## Bulunduğu Bölgeye Göre Getiri Bantları



\*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."