

# RİSKOMETRE

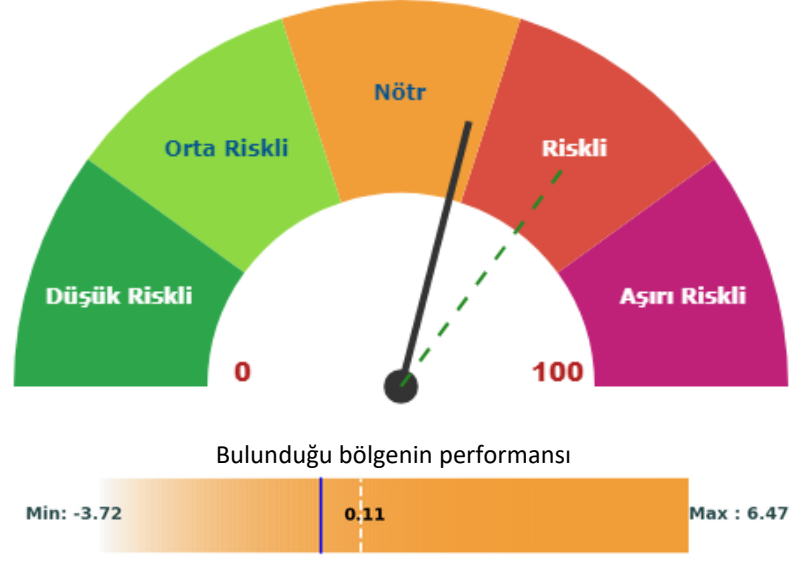
BIST100

23 - 29 Eylül 2024

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

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftalık dönemde BIST100 Endeksi yaklaşık **%3.1 değer kazanmıştır**. Model nötr bölgeye girdiğinden beri BIST100 Endeksi performansı, bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında bulunmaktadır**.

Bu hafta **58** Bir hafta önce **70** Bir ay önce **56**

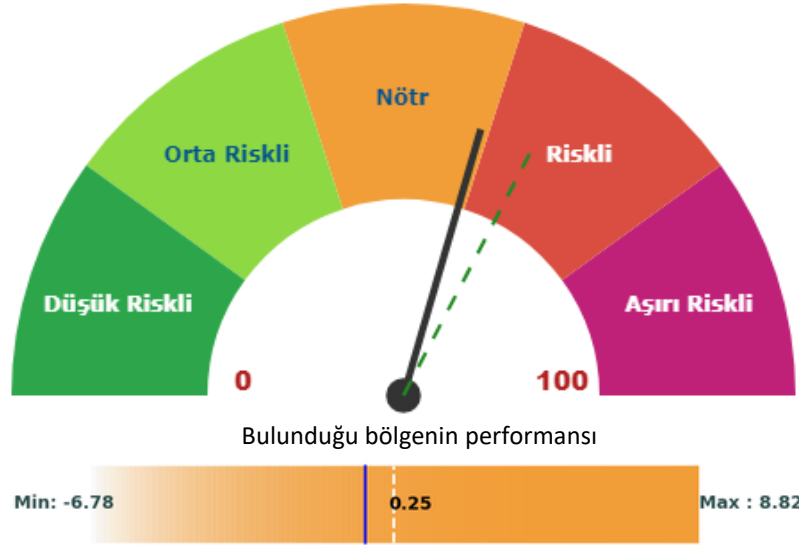


## BIST TEKNOLOJİ

BIST Teknoloji modeli 1 aydır riskli bölgede yer alırken bu hafta **nötr bölgeye** geçiş yapmıştır.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada BIST Teknoloji Endeksi yaklaşık **%1 değer kazanmıştır**. Model nötr bölgeye girdiğinden beri BIST Teknoloji Endeksi getirisi **tarihsel ortalamasının altında bulunmaktadır**.

Bu hafta **59** Bir hafta önce **66** Bir ay önce **63**

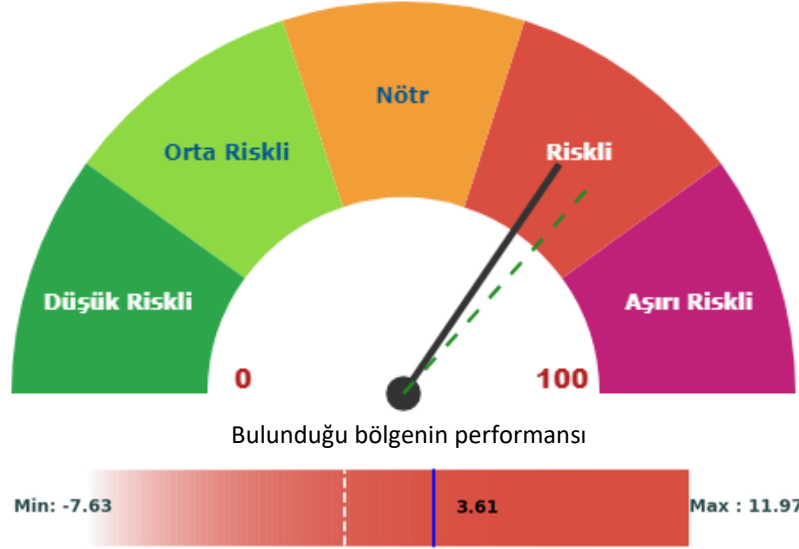


## BIST BANKACILIK

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

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada BIST Bankacılık Endeksi yaklaşık **%5.5 değer kazanmıştır**. Model riskli bölgeye girdiğinden beri BIST Bankacılık Endeksi performansı **ortalamanın üzerinde yer almaktadır**.

Bu hafta **69** Bir hafta önce **73** Bir ay önce **72**

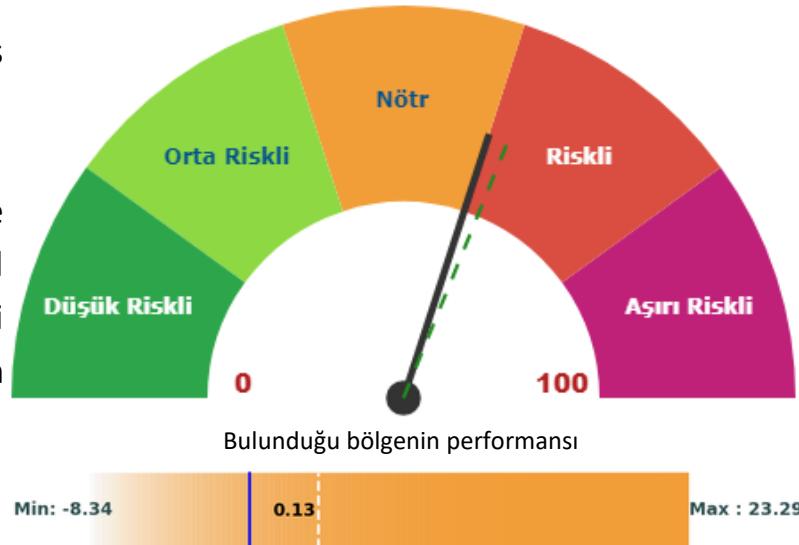


## BIST SINAI

1 aylık dönemde riskli bölge içinde yer alan BIST Sınai modeli bu hafta **nötr bölge** sınırına geçiş yapmıştır.

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

Bu hafta **60** Bir hafta önce **62** Bir ay önce **64**

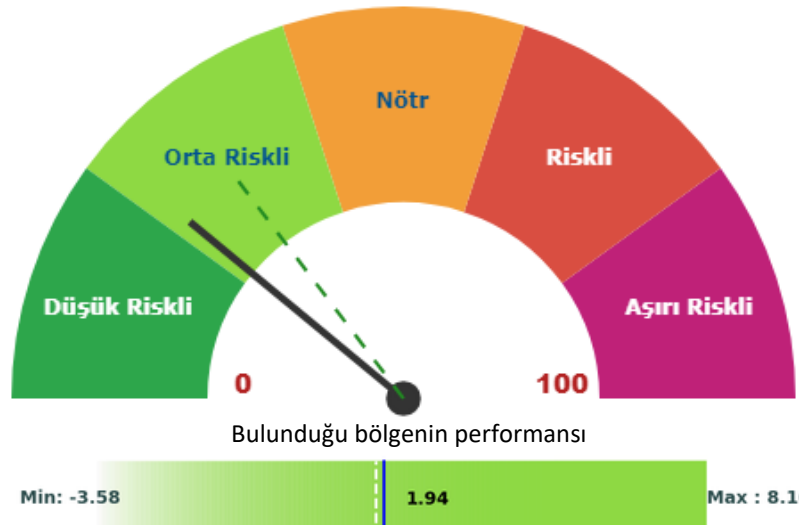


## ALTIN

Altın modeli 1 ayda **orta riskli bölge** içinde yer alırken bu hafta düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin orta risk sinyali verdiği 1 ayda Altın fiyatları yaklaşık **%4 değer kazanmıştır**. Model bu bölgeye girdiğinden beri Altının performansı bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının yakınında bulunmaktadır**.

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



# RİSKOMETRE

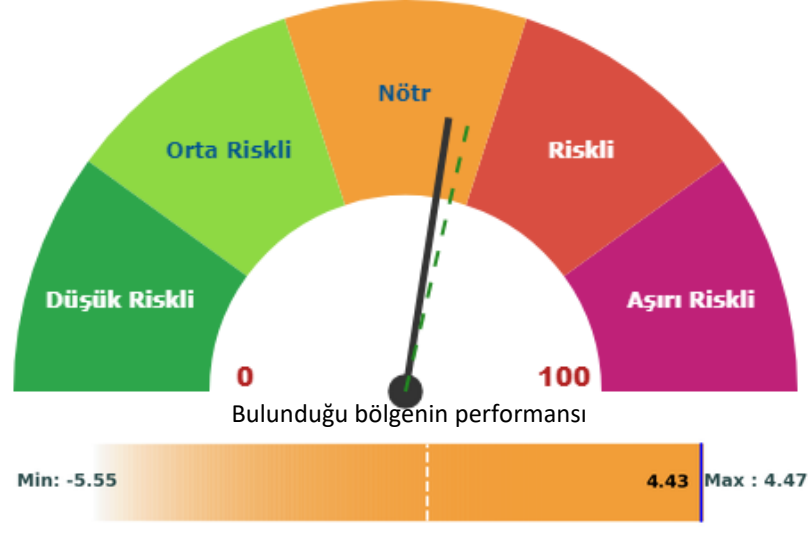
S&P

23 - 29 Eylül 2024

ABD Hisse Senedi modeli 1 aylık dönemde **nötr bölgede** dalgalı seyretmiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada endeks **%2.1 değer kazanmıştır**. Model nötr bölgeye girdiğinden beri S&P Endeksinin performansı, bu bölgedeki **tarihsel maksimum değerine ulaşmıştır**.

Bu hafta **55** Bir hafta önce **57** Bir ay önce **53**

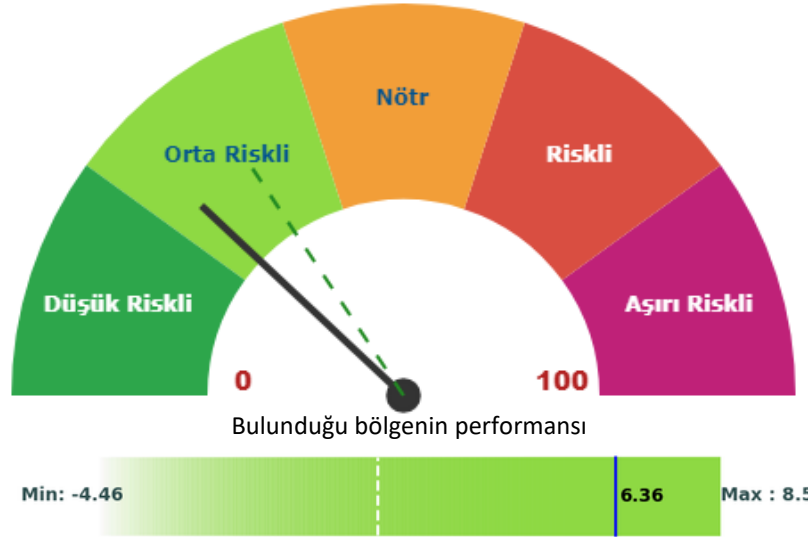


## NASDAQ

1 aylık dönemde **orta riskli bölge** içinde yer alan Nasdaq Modeli bu hafta düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada NASDAQ Endeksi yaklaşık **%2.1 getiri sağlamıştır**. Model orta riskli bölgeye girdiğinden beri endeksin getirisi bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerindedir**.

Bu hafta **24** Bir hafta önce **31** Bir ay önce **28**



## DAX

1 aylık dönemde **orta riskli bölgede** yer alan Almanya Hisse Senedi bu hafta düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada DAX Endeksi **yaklaşık %1 getiri sağlamıştır**. Endeksin performansı, model orta riskli bölgeye girdiğinden beri tarihsel **ortalamasının altında bulunmaktadır**.

Bu hafta **36** Bir hafta önce **40** Bir ay önce **36**

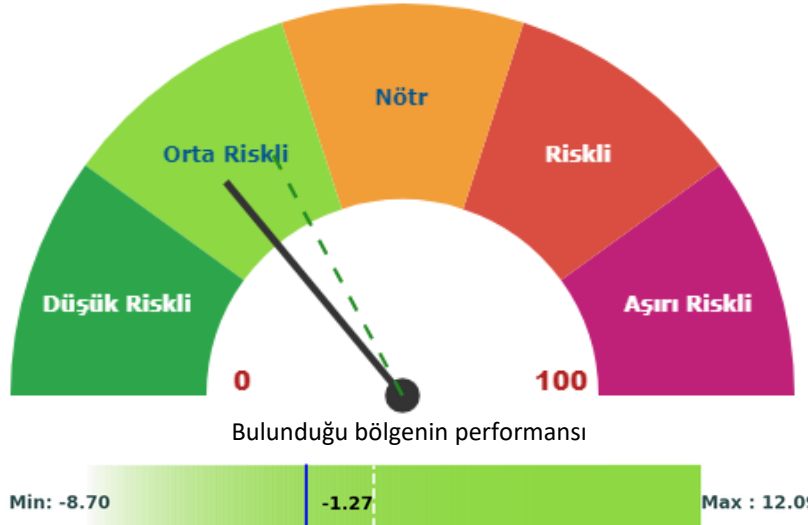


## NIKKEI

Japonya Hisse Senedi Modeli 1 aylık dönemde **orta riskli bölge** içinde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada Nikkei Endeksi yaklaşık **%2.4 değer kazanmıştır**. Model bu bölgeye girdiğinden beri endeks **performansı bu bölgedeki tarihsel ortalamasının altında yer almaktadır**.

Bu hafta **28** Bir hafta önce **34** Bir ay önce **40**

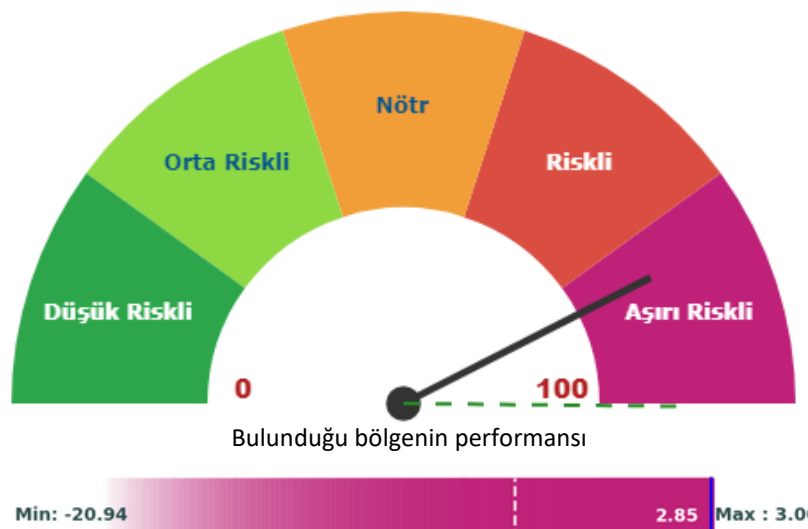


## PETROL

Petrol modeli geçen hafta **aşırı riskli bölge maksimum** değerine ulaştıktan sonra bu hafta düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftalık dönemde Petrol fiyatları yaklaşık **%4 değer kazanmıştır**. Model bu bölgeye girdiğinden beri petrolün getirisi bölgedeki **tarihsel maksimum değerine çok yakın bulunmaktadır**.

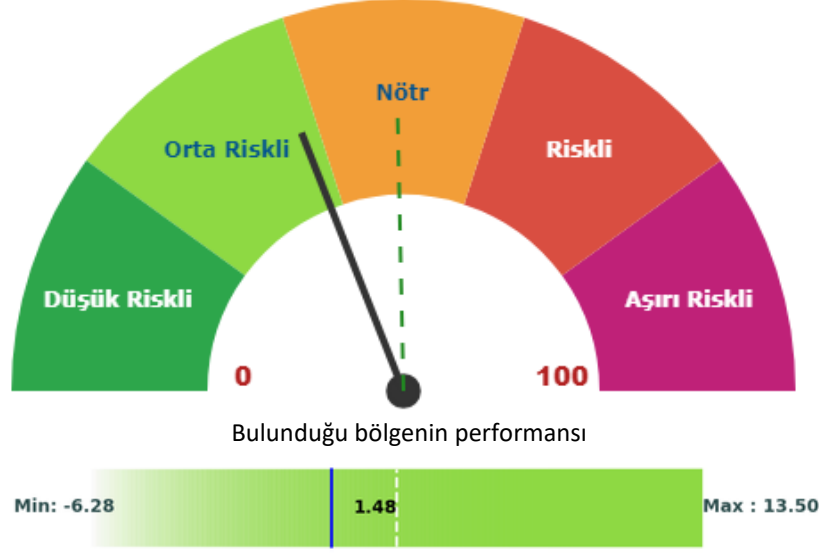
Bu hafta **85** Bir hafta önce **100** Bir ay önce **79**



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

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda Gümüş fiyatları yaklaşık **%5 değer kazanmıştır**. Model orta riskli bölgeye girdiğinden beri Gümüşün getirisi bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında bulunmaktadır**.

Bu hafta **38** Bir hafta önce **49** Bir ay önce **47**

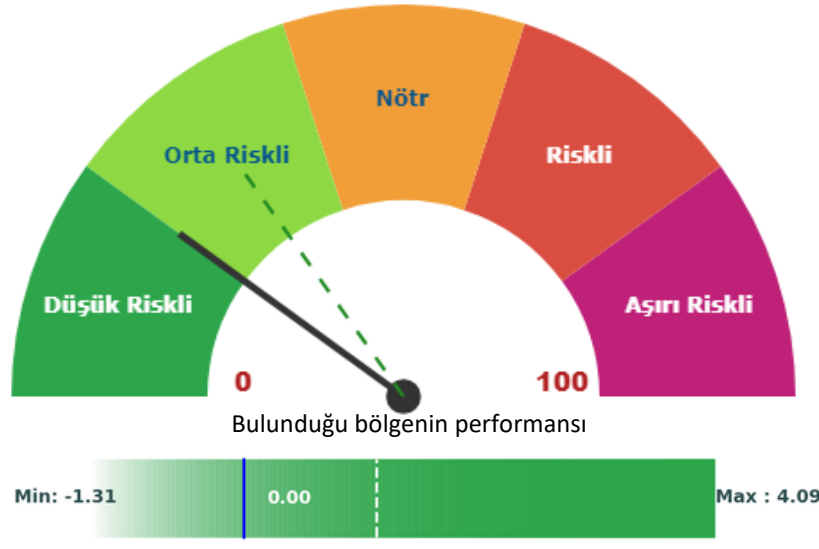


## GBPUSD

GBPUSD modeli bu hafta orta riskli bölgeden **düşük riskli bölge** sınırına geçiş yapmıştır.

Model 1 haftada düşük riskli yöne ilerlerken GBPUSD paritesi yaklaşık **%1.5 değer kazanmıştır**. GBPUSD paritesi performansı, bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında seyretmektedir**.

Bu hafta **20** Bir hafta önce **30** Bir ay önce **14**

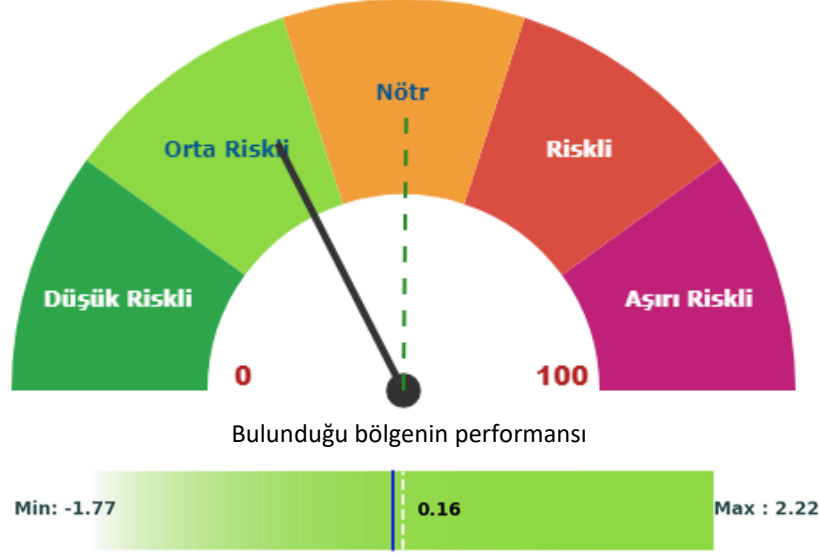


## EURUSD

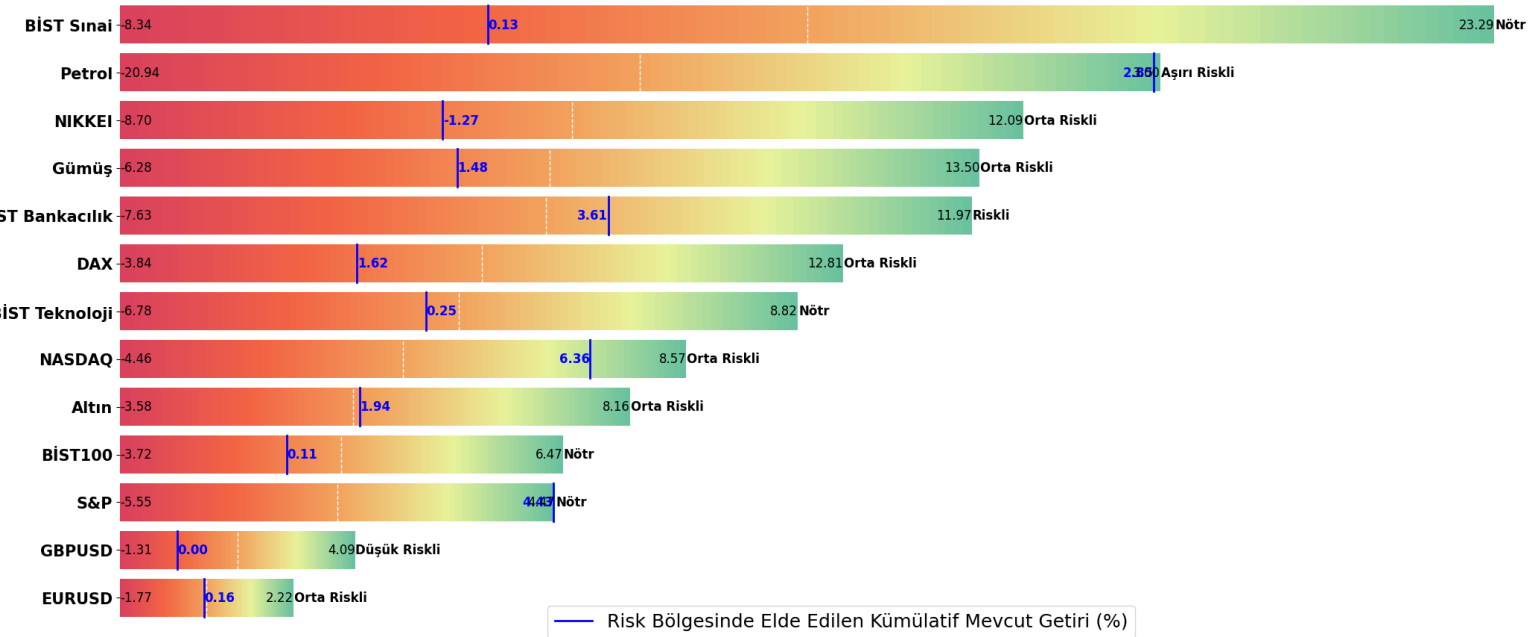
EURUSD modeli bu hafta nötr bölgeden **orta riskli bölgeye** geçiş yapmıştır.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada EURUSD paritesi yaklaşık **%1 değer kazanmıştır**. EURUSD paritesi performansı orta riskli bölgedeki **tarihsel ortalamasının yakınında bulunmaktadır**.

Bu hafta **35** Bir hafta önce **50** Bir ay önce **39**

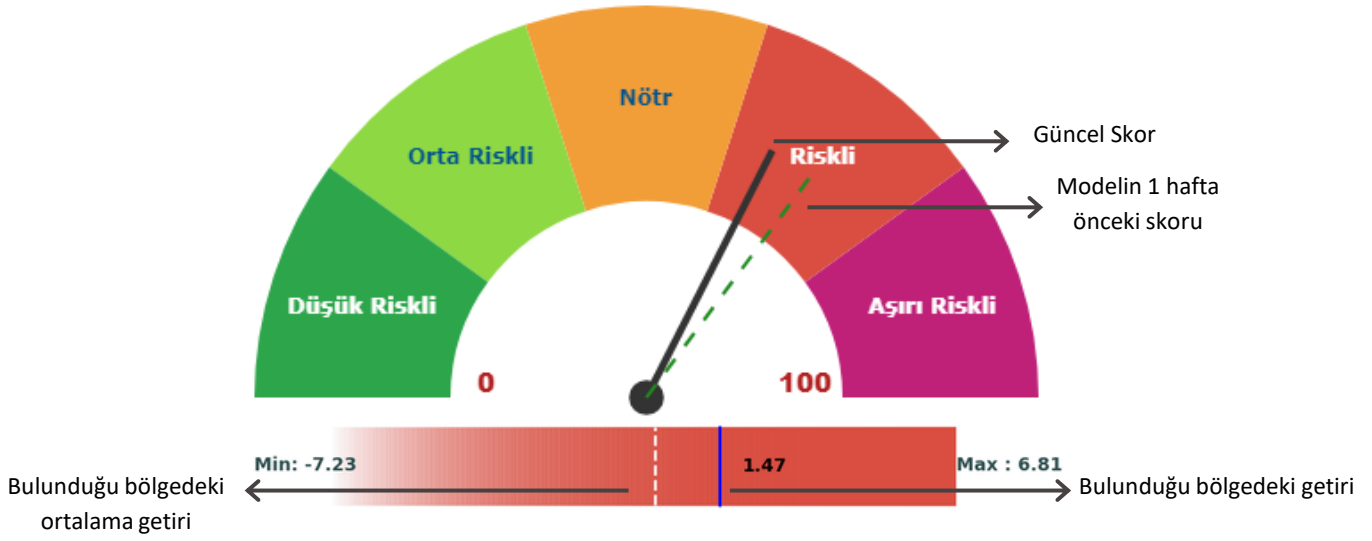


## Bulunduğu Bölgeye Göre Getiri Bantları



\*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:



## 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."