

RİSKOMETRE

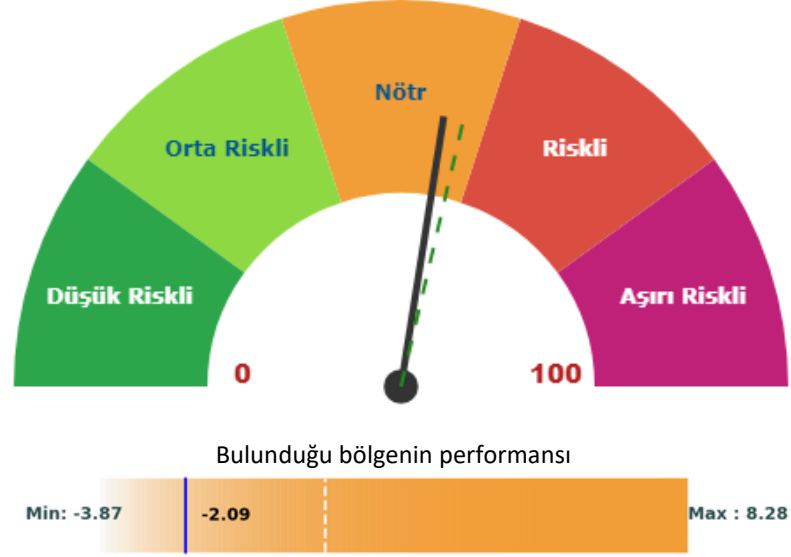
BIST100

30 Eylül - 6 Ekim 2024

BIST100 modeli 1 aylık dönemde **nötr bölgede** yer alırken bu hafta düşük riskli yöne ilerleyerek 1 ay önceki konumuna dönüş yapmıştır.

BIST100 Endeksi 1 haftalık dönemde yaklaşık **%1.5 değer kazanmıştır**. Model nötr bölgeye girdiğinden beri BIST100 Endeksi performansı, bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında** bulunmaktadır.

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

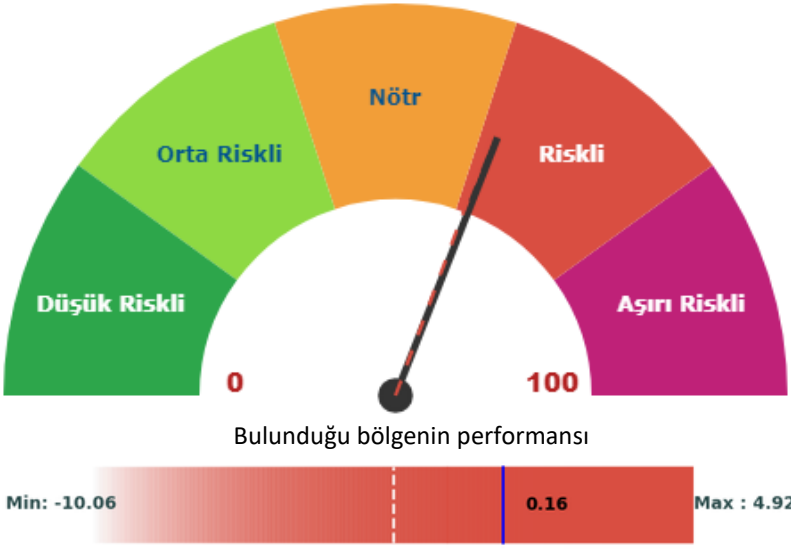


BIST TEKNOLOJİ

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

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftada BIST Teknoloji Endeksi yaklaşık **%1.5 değer kaybetmiştir**. Model riskli bölgeye girdiğinden beri BIST Teknoloji Endeksi getirisi **tarihsel ortalamasının üzerinde** bulunmaktadır.

Bu hafta **62** Bir hafta önce **61** Bir ay önce **64**

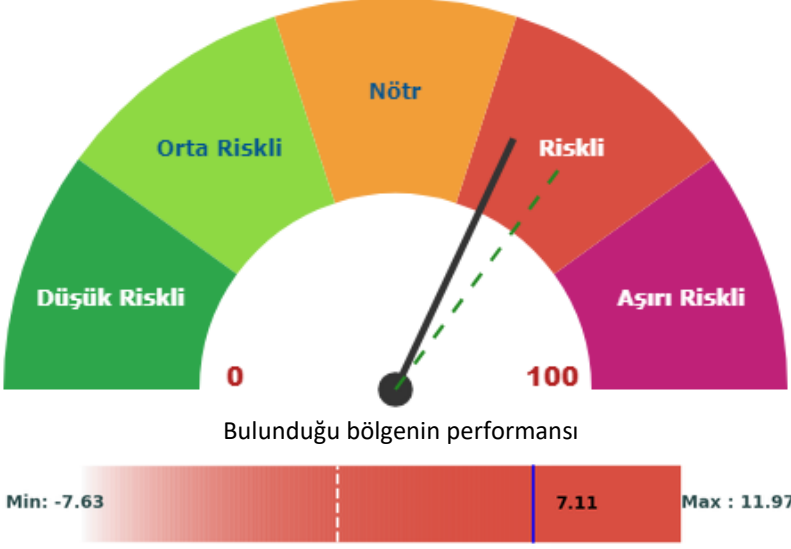


BIST BANKACILIK

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

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada BIST Bankacılık Endeksi yaklaşık **%4 değer kazanmıştır**. Model riskli bölgeye girdiğinden beri BIST Bankacılık Endeksi performansı bu bölgedeki **ortalamaının üzerinde** yer almaktadır.

Bu hafta **64** Bir hafta önce **70** Bir ay önce **70**

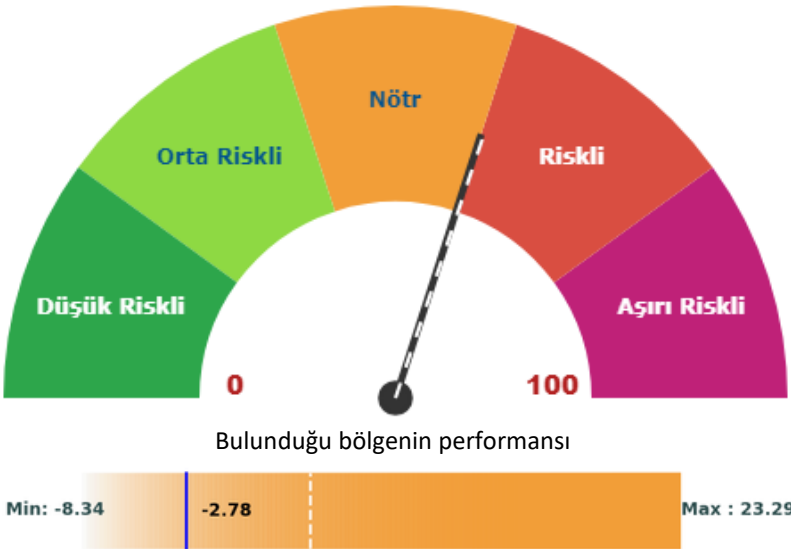


BIST SINAI

1 aylık dönemde riskli bölgeden **nötr bölge** sınırına geçiş yapan BIST Sınai Modeli bu hafta stabil seyretmiştir.

BIST Sınai Endeksi, nötr sinyali verdiği 1 haftada yaklaşık **%3 değer kaybetmiştir**. Model nötr bölgeye girdiğinden beri BIST Sınai Endeksi performansı bu bölgedeki tarihsel **ortalamaının altında** bulunmaktadır.

Bu hafta **60** Bir hafta önce **60** Bir ay önce **63**

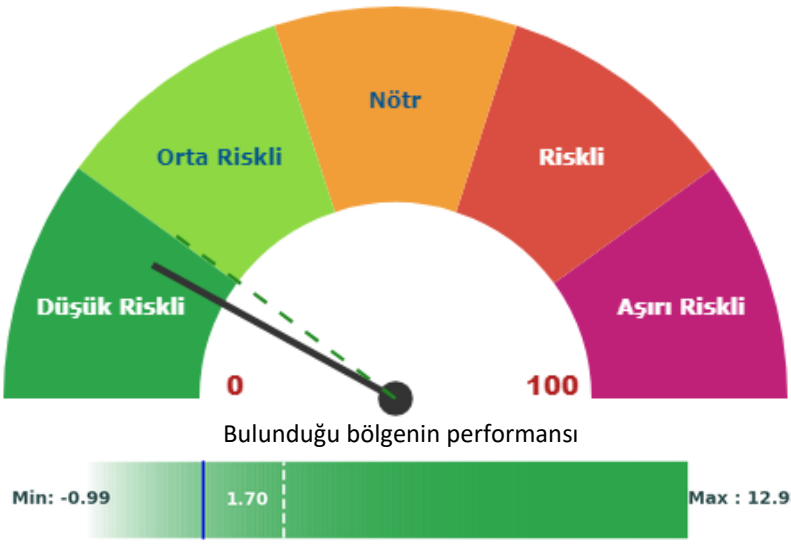


ALTIN

Altın modeli 1 ayda orta riskli bölgeden **düşük riskli** bölgeye geçmiş ve bu hafta da düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda Altın fiyatları yaklaşık **%6.5 değer kazanmıştır**. Model bu bölgeye girdiğinden beri Altının getirisi bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında** bulunmaktadır.

Bu hafta **16** Bir hafta önce **20** Bir ay önce **26**



RİSKOMETRE

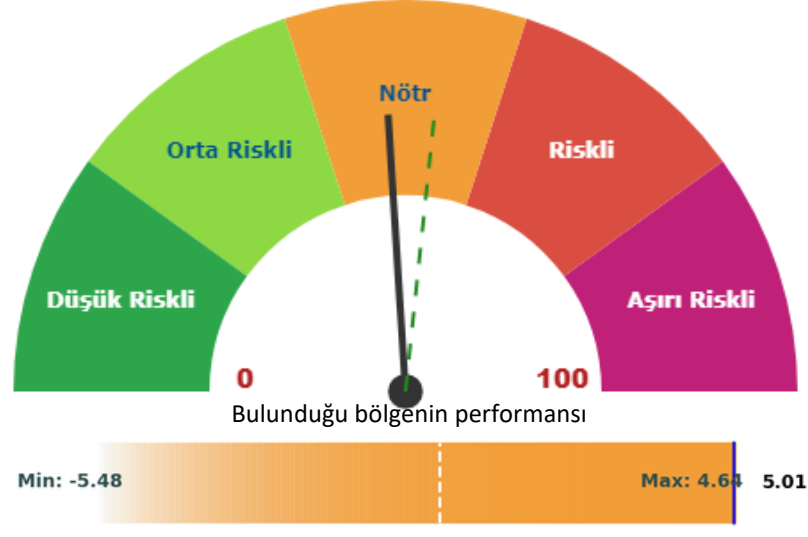
S&P

30 Eylül - 6 Ekim 2024

ABD Hisse Senedi modeli 1 aylık dönemde **nötr bölgede** düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda endeks **%2.7 değer kazanmıştır**. Model nötr bölgeye girdiğinden beri S&P Endeksinin performansı, bu bölgedeki **tarihsel maksimum değerine ulaşmıştır**.

Bu hafta **48** Bir hafta önce **53** Bir ay önce **54**

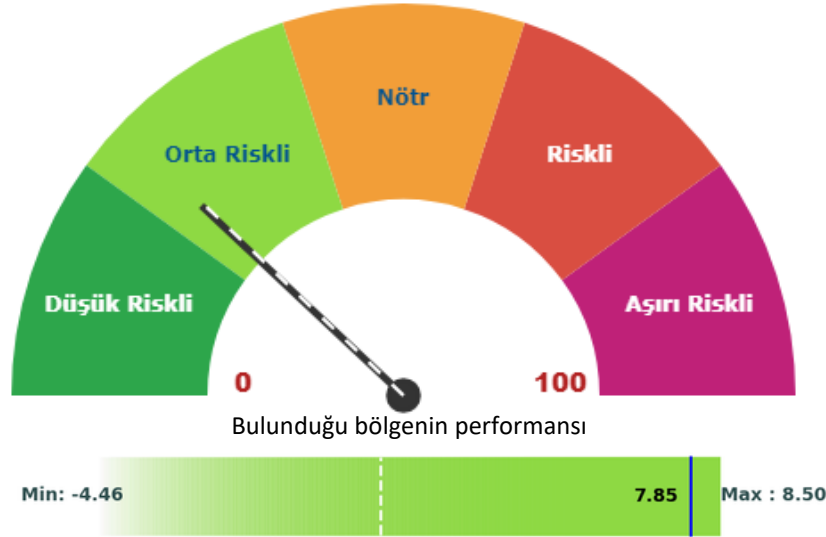


NASDAQ

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

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda NASDAQ Endeksi yaklaşık **%4 getiri sağlamıştır**. Model orta riskli bölgeye girdiğinden beri endeksin getirisi bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerindedir**.

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



DAX

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

Modelin orta risk sinyali verdiği 1 ayda DAX Endeksi **yaklaşık %2 getiri sağlamıştır**. Endeksin performansı, model orta riskli bölgeye girdiğinden beri tarihsel **ortalamasının altında bulunmaktadır**.

Bu hafta **40** Bir hafta önce **38** 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 **%7 değer kazanmıştır**. Model bu bölgeye girdiğinden beri endeks **performansı bu bölgedeki tarihsel ortalamasının üzerinde yer almaktadır**.

Bu hafta **28** Bir hafta önce **30** Bir ay önce **34**

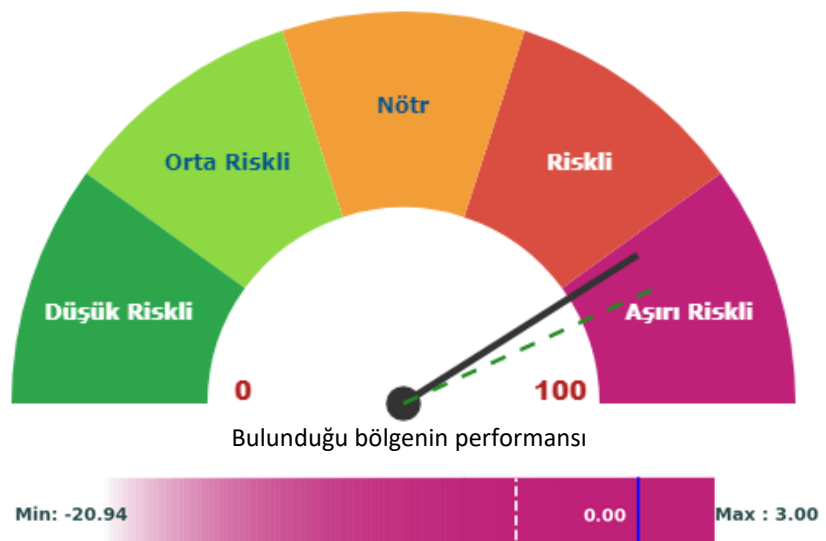


PETROL

1 aydır aşırı riskli yönde ilerleyen Petrol modeli bu hafta **aşırı riskli bölgede** düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin aşırı riskli yöne ilerlediği 1 ayda Petrol fiyatları yaklaşık **%9 değer kaybetmiştir**. Model bu bölgeye girdiğinden beri petrolün getirisi bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır**.

Bu hafta **82** Bir hafta önce **86** Bir ay önce **70**



RİSKOMETRE

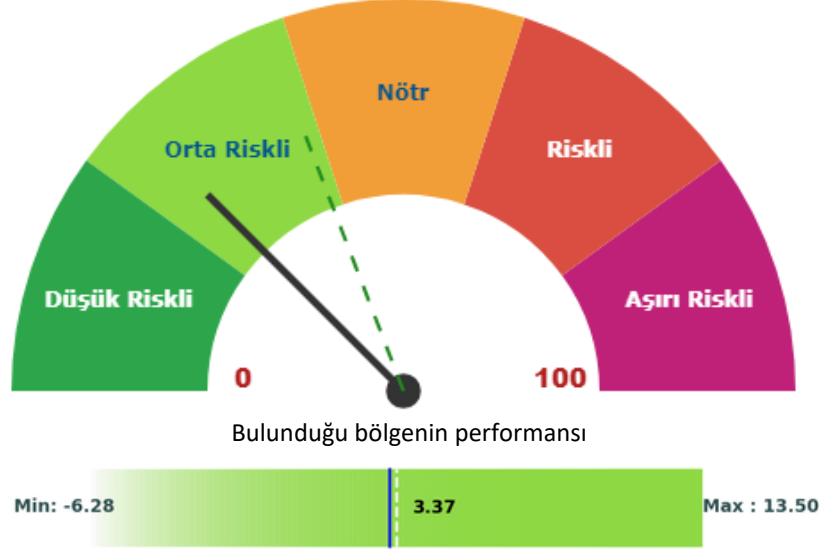
GÜMÜŞ

30 Eylül - 6 Ekim 2024

Gümüş modeli 1 aylık dönemde nötr bölgeden **orta riskli bölgeye** geçiş yapmıştır.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda Gümüş fiyatları yaklaşık **%10 değer kazanmıştır**. Model orta riskli bölgeye girdiğinden beri Gümüşün getirisi bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının yakınında bulunmaktadır**.

Bu hafta **25** Bir hafta önce **38** Bir ay önce **50**

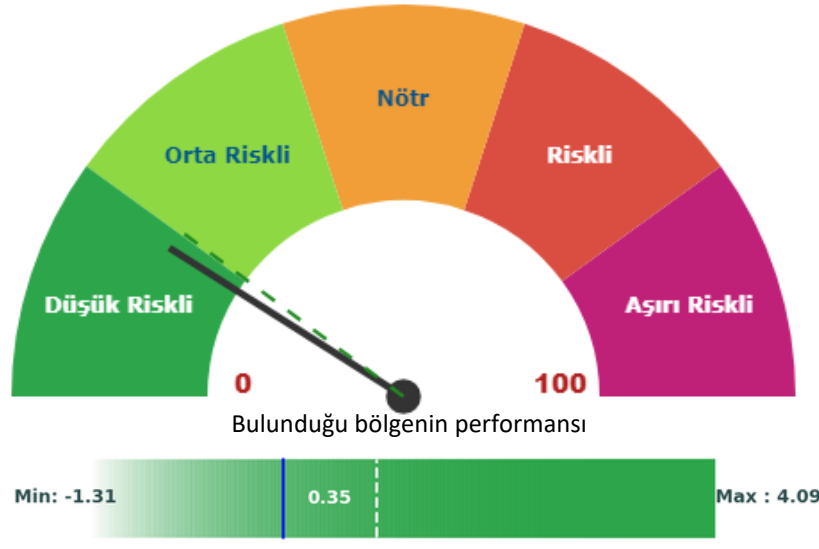


GBPUSD

GBPUSD modeli 1 aylık dönemde **düşük riskli bölgede** bulunmaktadır.

Model 1 ayda düşük riskli yöne ilerlerken GBPUSD paritesi yaklaşık **%2 değer kazanmıştır**. GBPUSD paritesi performansı, düşük riskli bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında seyretmektedir**.

Bu hafta **18** Bir hafta önce **20** Bir ay önce **19**

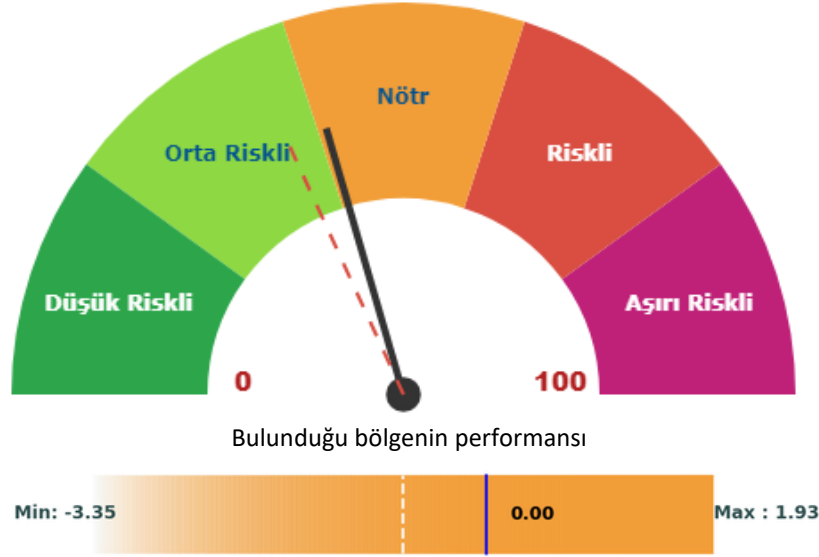


EURUSD

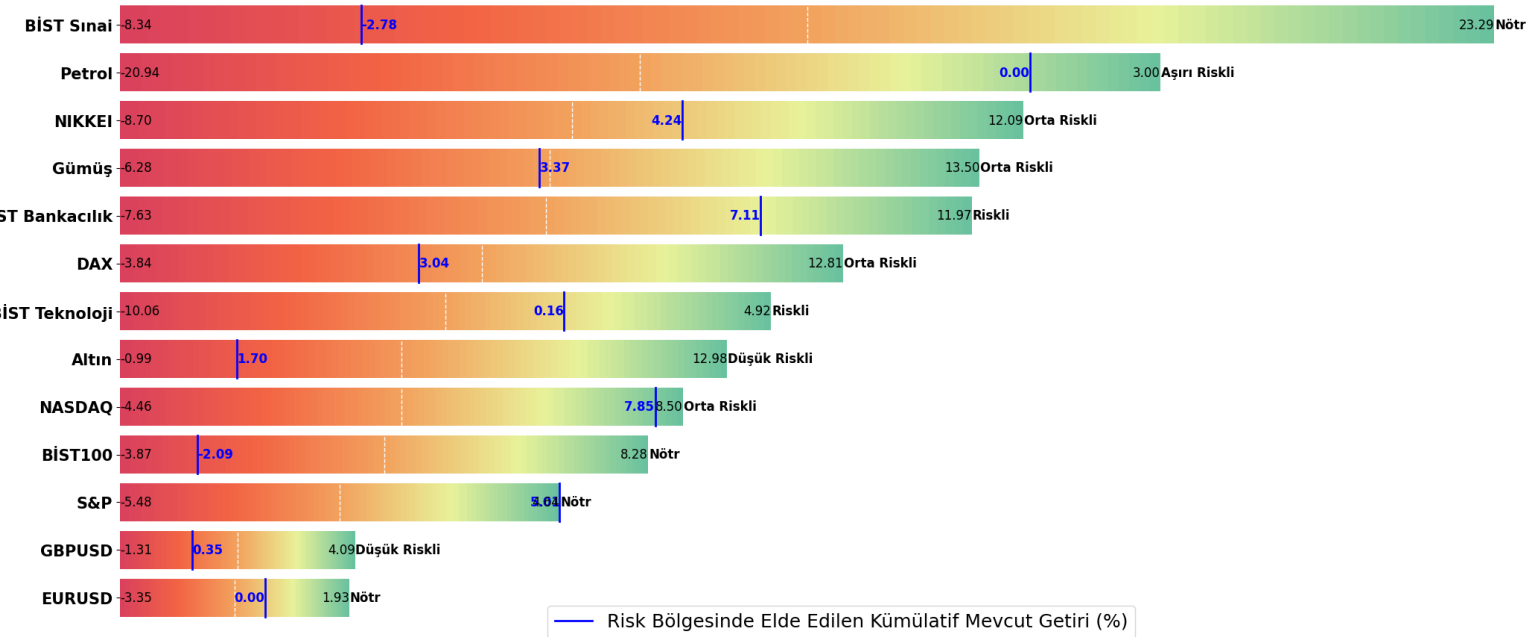
EURUSD modeli bu hafta orta riskli bölgeden **nötr bölgeye** geçiş yapmıştır.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftada EURUSD paritesi yaklaşık **%0.5 değer kaybetmiştir**. EURUSD paritesi performansı nötr bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır**.

Bu hafta **41** Bir hafta önce **36** Bir ay önce **30**

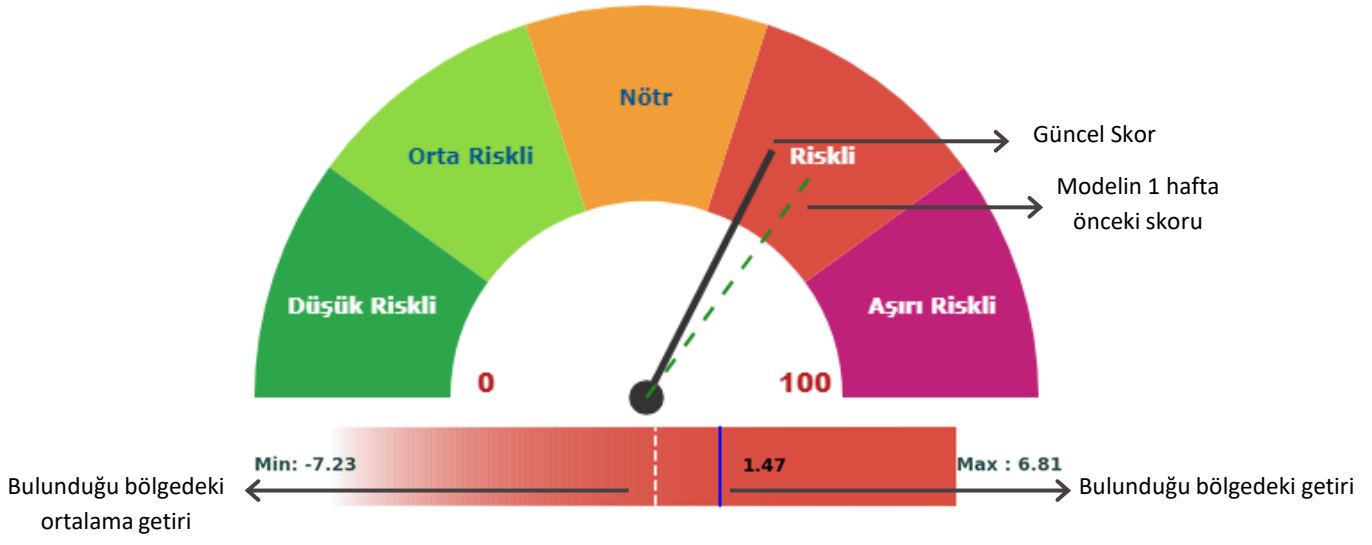


Bulunduğu Bölgeye Göre Getiri Bantları



*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

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."