

RİSKOMETRE

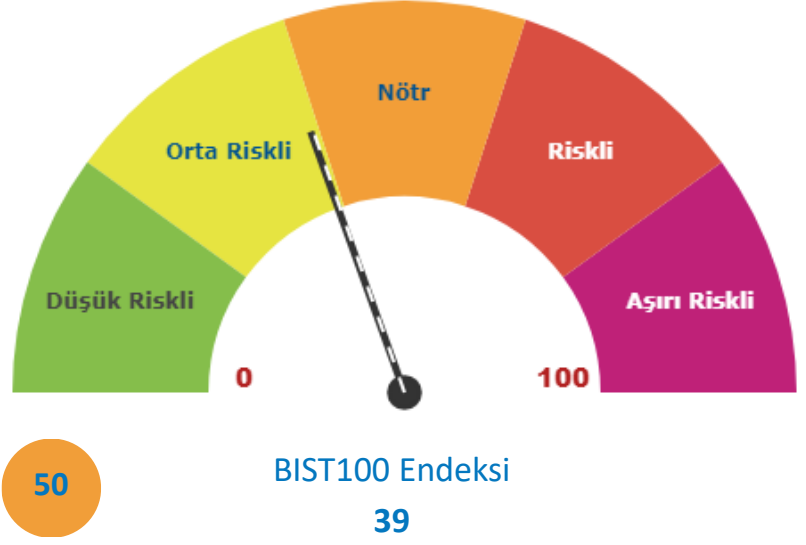
BIST100

11 - 17 Aralık 2023

BIST100 modeli 3 hafta önce geçiş yaptığı **orta riskli** bölgede konumunu korumaktadır.

Son 1 ayda modelin **düşük** riskli yönde ilerlediği bu dönemde BIST100 Endeksinde yaklaşık **%2.5 getiri** gözlenmiştir.

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

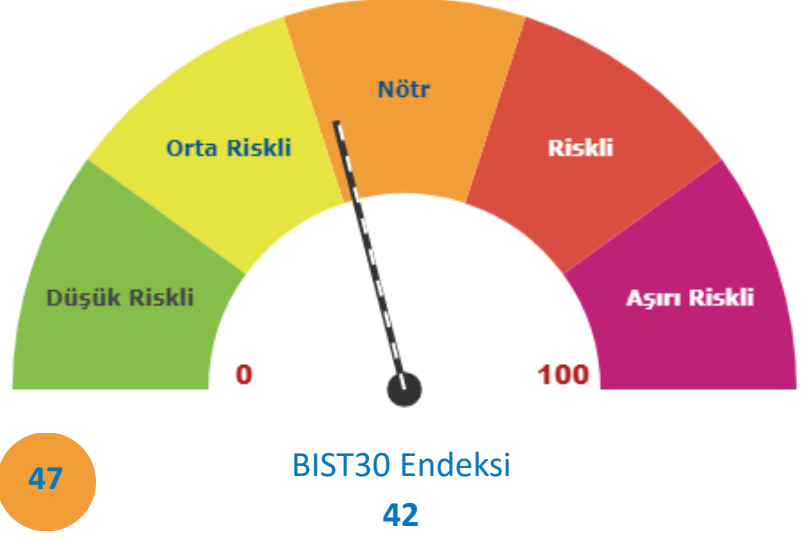


BIST30

BIST30 modeli bu hafta bulunduğu **nötr bölge** içinde konumunu korurken 1 ayda düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 aylık dönemde BIST30 Endeksi yaklaşık **%6 getiri sağlamıştır.**

Bu hafta **42** Bir hafta önce **42** Bir ay önce **47**

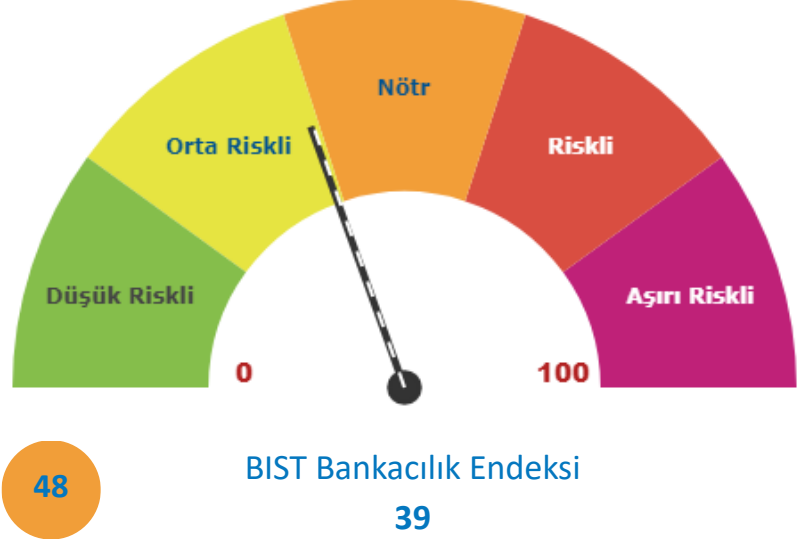


BIST BANKACILIK

Geçen hafta **orta riskli** bölgeye geçiş yapan BIST Bankacılık modeli bu hafta da konumunu korumaktadır.

Model 1 aylık dönemde düşük riskli yöne ilerlerken BIST Bankacılık Endeksi yaklaşık **%15 değer kazanmıştır.**

Bu hafta **39** Bir hafta önce **39** Bir ay önce **48**

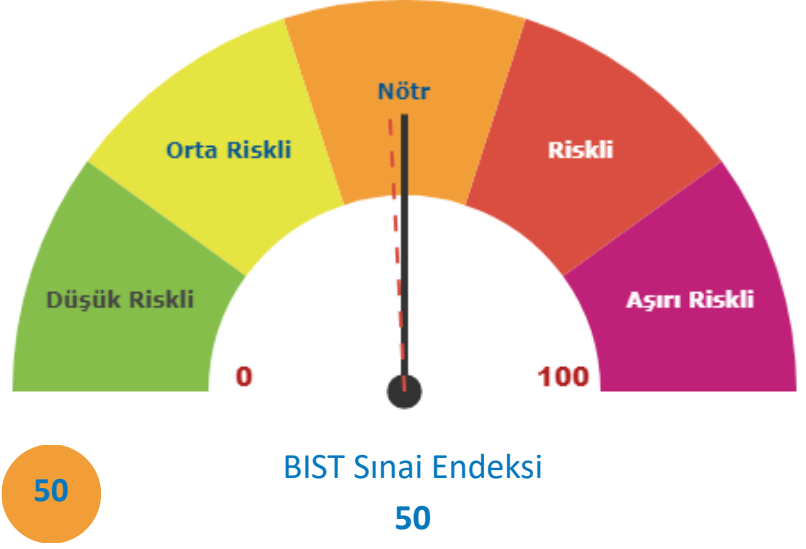


BIST SINAI

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

Model 1 ayda yatay seyredirken, düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftalık dönemde BIST Sınai Endeksinde yaklaşık **%2 değer kaybı** gözlenmiştir.

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

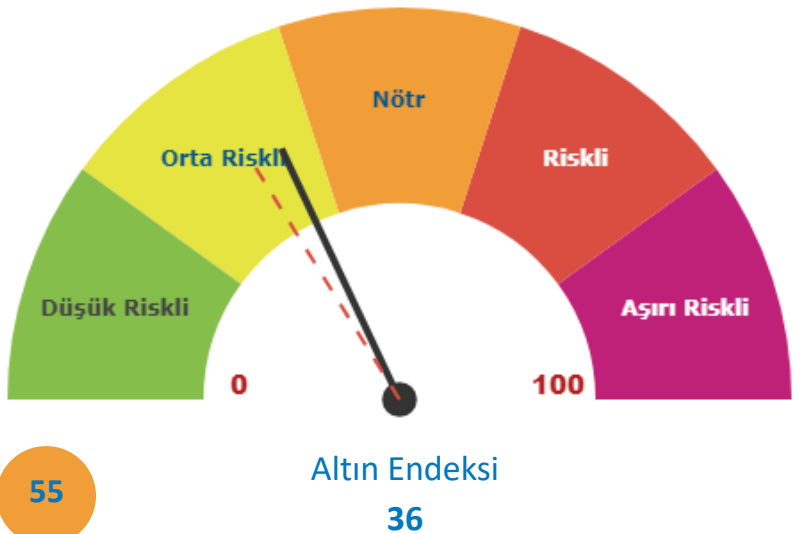


ALTIN

Altın modeli geçtiğimiz hafta nötr bölgeden geçiş yaptığı **orta riskli** bölge içinde riskli yöne ilerleyerek oynak hareketini sürdürmektedir.

Altın fiyatları 1 haftada yaklaşık **%2 değer kaybederken**, 1 ayda ise yaklaşık **%5 değer kazanmıştır.**

Bu hafta **36** Bir hafta önce **32** Bir ay önce **55**



RİSKOMETRE

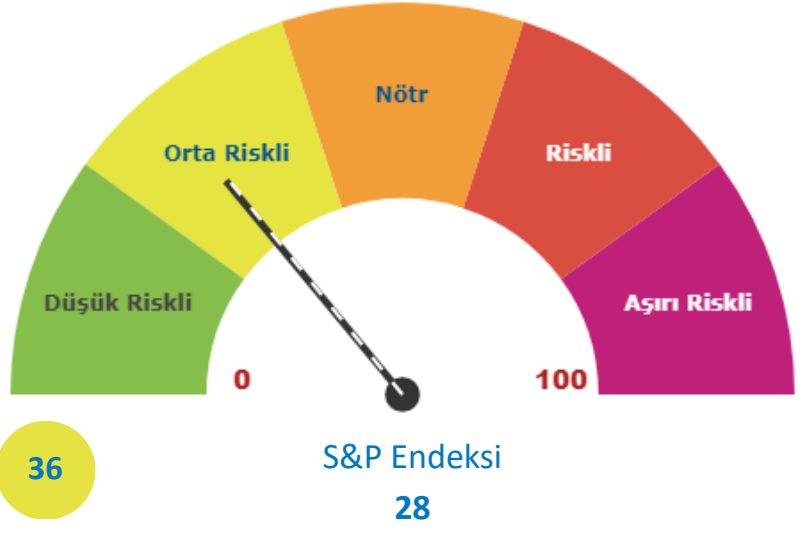
S&P

11 - 17 Aralık 2023

ABD Hisse Senedi modeli 1 ayda düşük riskli yöne ilerlerken bu hafta bulunduğu **orta riskli** bölge içinde konumunu korumaktadır.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 aylık dönemde S&P Endeksinde yaklaşık **%4.5 getiri gözlenmiştir**.

Bu hafta **28** Bir hafta önce **28** Bir ay önce **36**

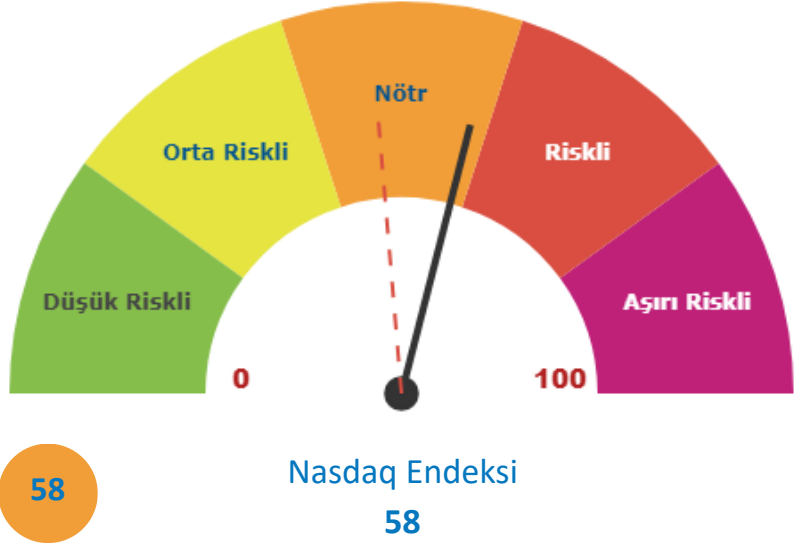


NASDAQ

NASDAQ modeli bu hafta bulunduğu **nötr** bölge içinde riskli yöne ilerleyerek 1 ay önceki konumuna dönüş yapmıştır.

Modelin 1 haftalık riskli yönde hareketi ile aynı dönemde NASDAQ Endeksi **%1 değer kaybı yaşamıştır**.

Bu hafta **58** Bir hafta önce **47** Bir ay önce **58**

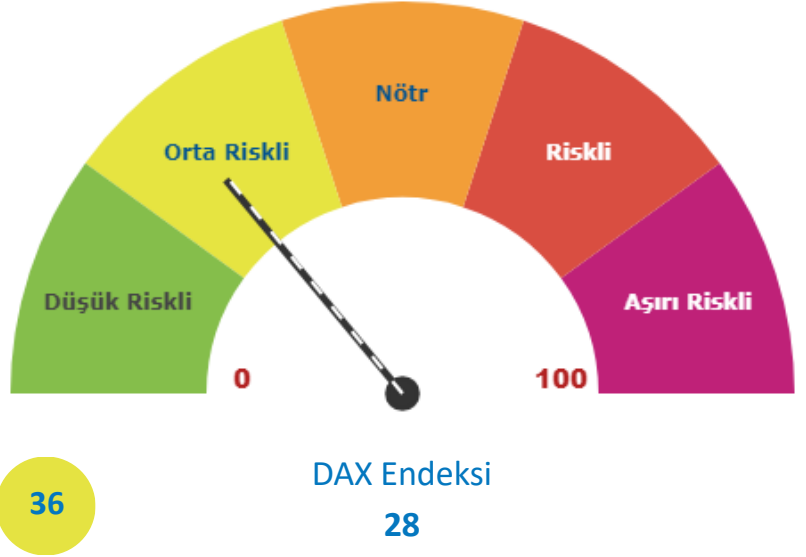


DAX

Almanya Hisse Senedi modeli 1 ayda **orta riskli** bölge içinde düşük riskli yöne ilerlerken bu hafta konumunu korumuştur.

Modelin stabil kaldığı 1 haftada DAX Endeksinde yaklaşık **%1.5**, 1 aylık düşük riskli yönde hareketi sırasında ise yaklaşık **%9.5 getiri gözlenmiştir**.

Bu hafta **28** Bir hafta önce **28** Bir ay önce **36**

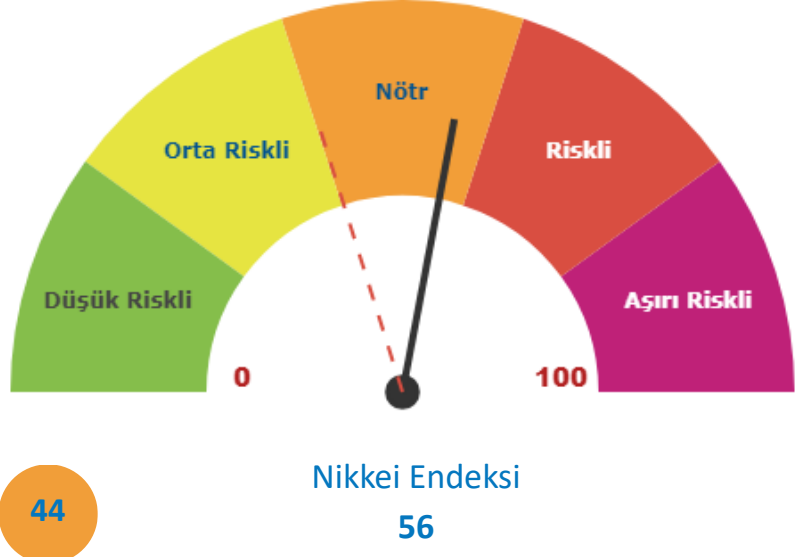


NIKKEI

Japonya Hisse Senedi modeli bu hafta orta riskli bölge sınırından **nötr** bölgeye geçiş yapmıştır.

Modelin 1 haftalık riskli yöndeki hareketi ile aynı dönemde Nikkei Endeksinde yaklaşık **%3.5**, 1 ayda ise **%1 değer kaybı** gözlenmiştir.

Bu hafta **56** Bir hafta önce **40** Bir ay önce **44**

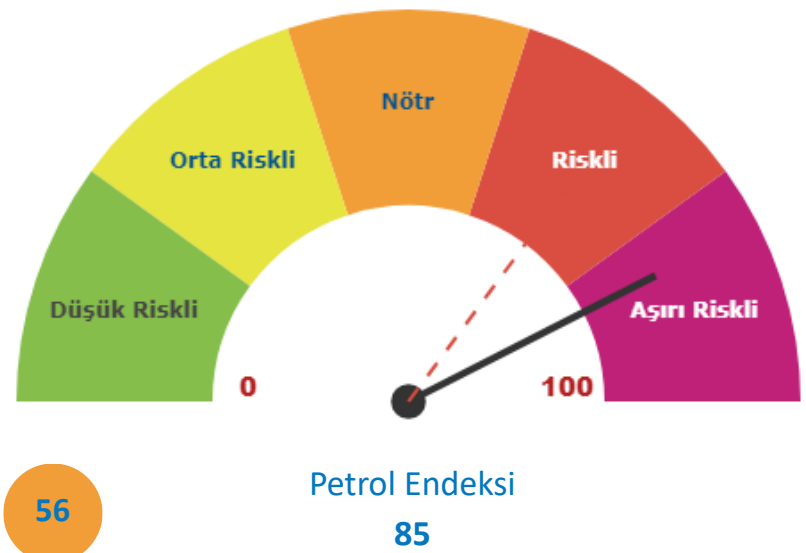


PETROL

Petrol modeli 3 haftadır bulunduğu riskli bölgeden **aşırı riskli** bölgeye geçiş yapmıştır.

Modelin 1 haftalık riskli yönde hareketi ile aynı dönemde petrol fiyatları yaklaşık **%6 değer kaybı yaşamış**, 1 aylık riskli yönde hareketi sırasında ise yaklaşık **%10 değer kaybetmiştir**.

Bu hafta **85** Bir hafta önce **70** Bir ay önce **56**



RİSKOMETRE

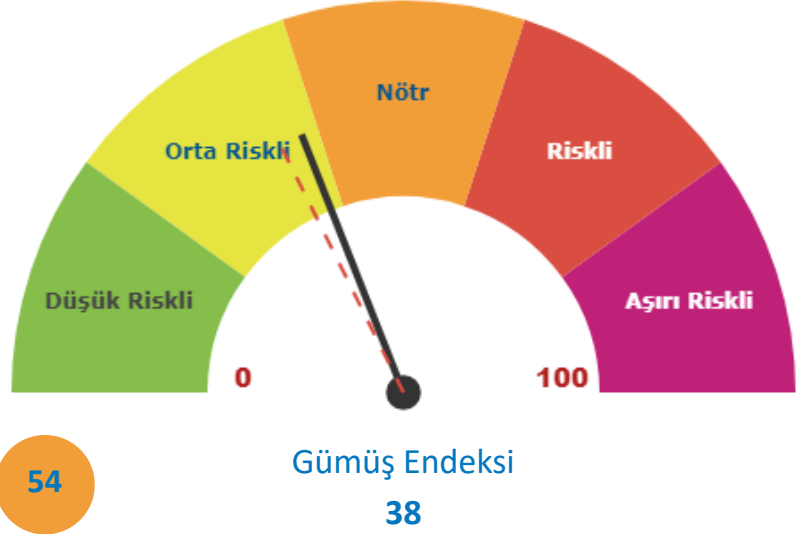
GÜMÜŞ

11 - 17 Aralık 2023

Gümüş modeli geçtiğimiz hafta geçiş yaptığı **orta riskli** bölge içinde riskli yöne ilerlemiştir.

Model 1 haftada riskli yönde ilerlerken Gümüş fiyatları yaklaşık **%6.5 değer kaybetmiş**, 1 ayda düşük riskli yönde ilerlerken ise yaklaşık **%7 getiri sağlamıştır**.

Bu hafta **38** Bir hafta önce **35** Bir ay önce **54**

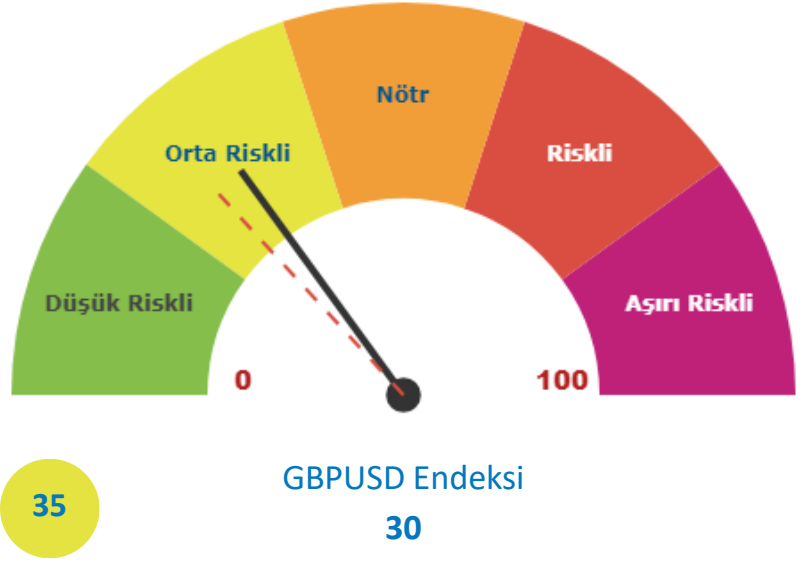


GBPUSD

GBPUSD modeli bu hafta bulunduğu **orta riskli** bölge içinde riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin 1 ayda düşük riskli yöne ilerlediği dönemde GBPUSD paritesi yaklaşık %1.5 değer kaybetmiş, riskli yöne ilerlediği bu hafta ise yaklaşık **%3 değer kazanmıştır**.

Bu hafta **30** Bir hafta önce **26** Bir ay önce **35**

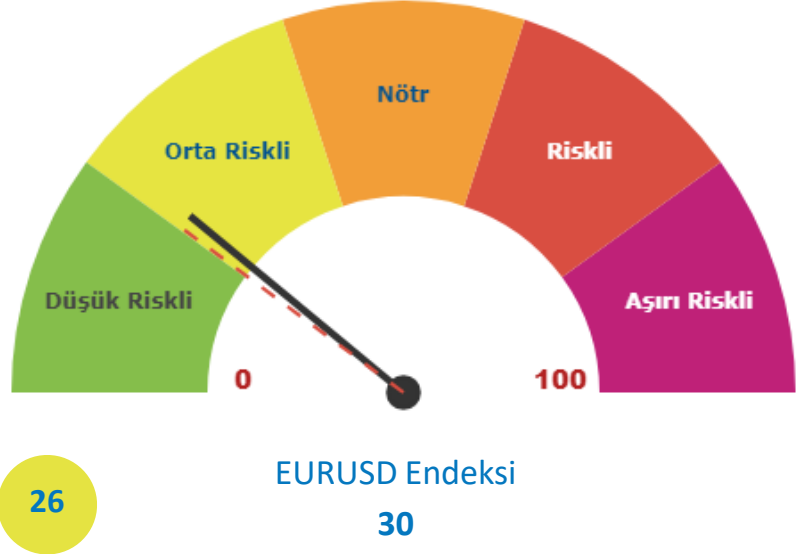


EURUSD

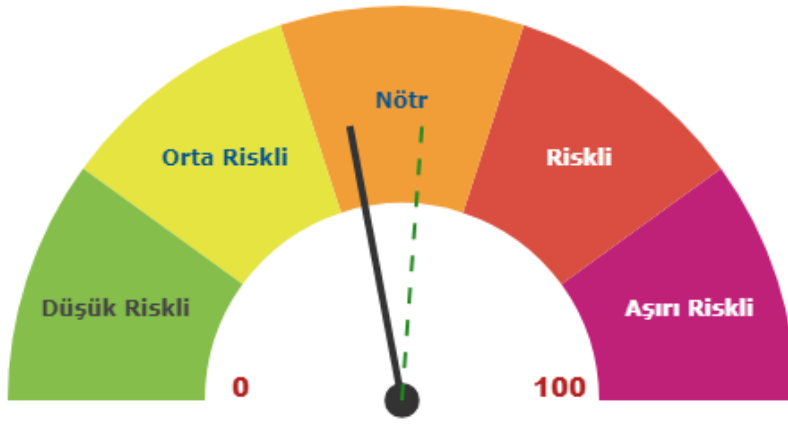
Geçtiğimiz hafta düşüşe geçen EURUSD modeli bu hafta orta riskli bölge içinde riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin riskli yöne ilerlediği bu hafta EURUSD paritesi yaklaşık **%1 değer kaybetmiştir**.

Bu hafta **30** Bir hafta önce **22** Bir ay önce **26**



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."