

# RİSKOMETRE

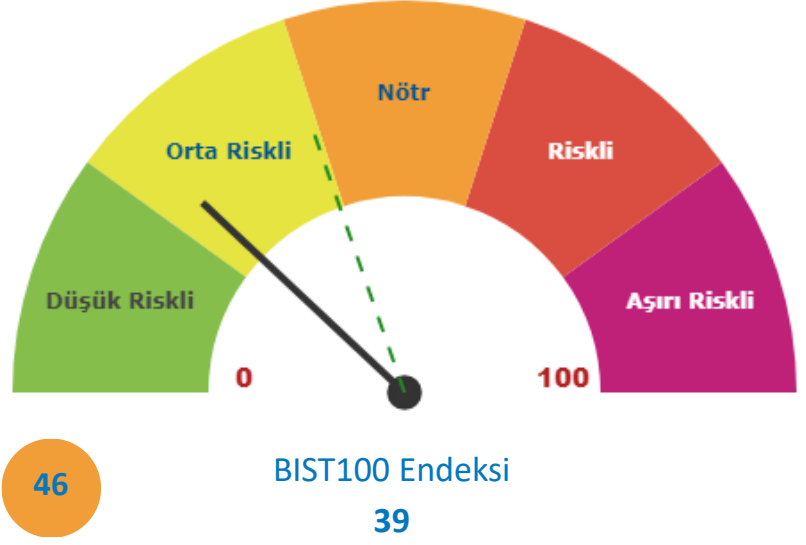
## BIST100

18 - 24 Aralık 2023

BIST100 modeli bu hafta **orta riskli** bölge içinde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin nötr bölgeden orta riskli bölgeye geçtiği 1 aylık dönemde BIST100 Endeksinde yaklaşık **%1.5**, 1 haftalık düşük riskli yönde hareketi sırasında ise yaklaşık **%1** **getiri gözlenmiştir.**

Bu hafta **24** Bir hafta önce **39** Bir ay önce **46**

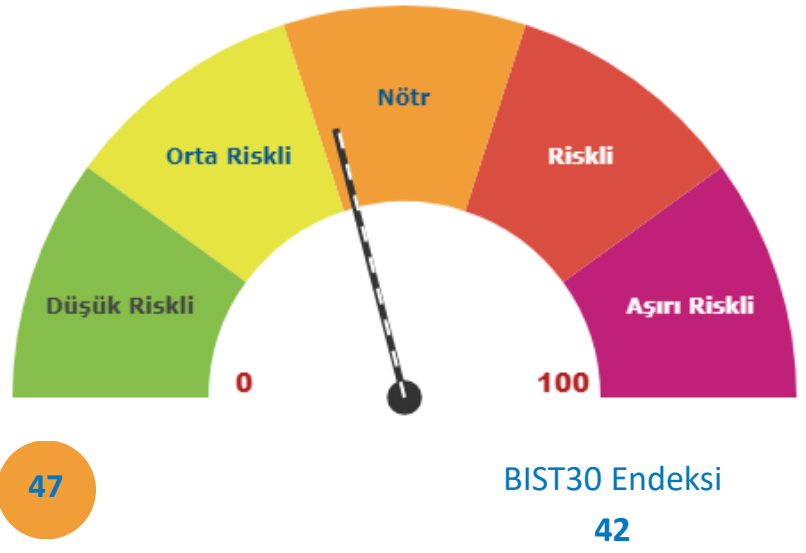


## BIST30

1 aylık dönemde düşük riskli yönde ilerleyen BIST30 modeli bu hafta bulunduğu **nötr bölge** içinde konumunu korumuştur.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 aylık dönemde BIST30 Endeksi yaklaşık **%4** **getiri sağlamıştır.**

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

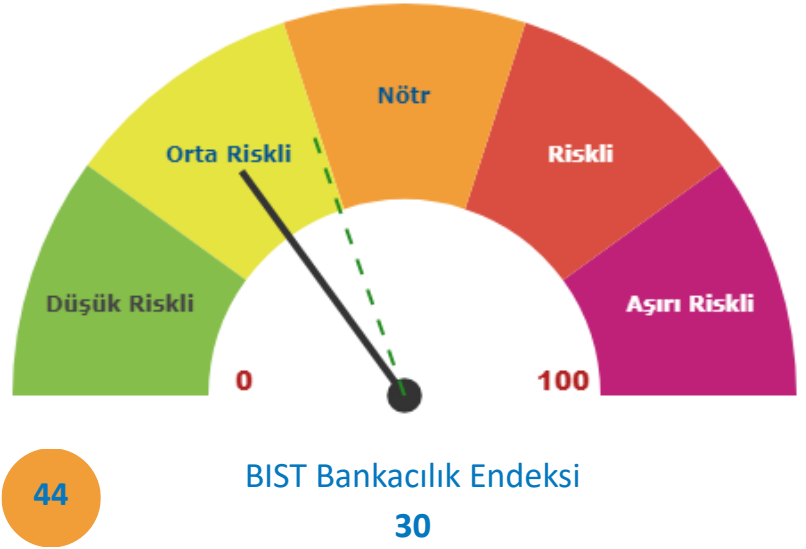


## BIST BANKACILIK

BIST Bankacılık modeli 3 hafta önce geçiş yaptığı **orta riskli** bölge içinde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Model 1 haftalık dönemde düşük riskli yönde ilerlerken BIST Bankacılık Endeksi yaklaşık **%9**, 1 aylık dönemde ise yaklaşık **%22** **değer kazanmıştır.**

Bu hafta **30** Bir hafta önce **39** Bir ay önce **44**

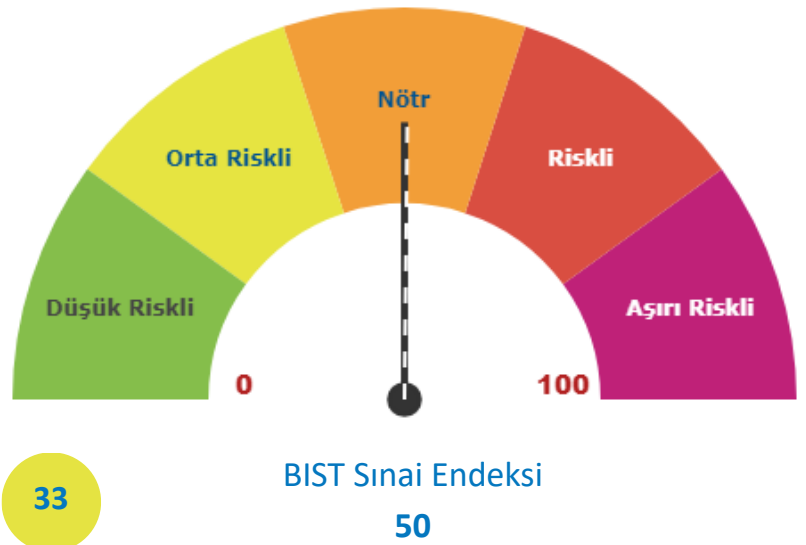


## BIST SINAI

BIST Sınai Endeksi modeli 1 ayda riskli yöne ilerlerken bu hafta bulunduğu **nötr** bölgede konumunu korumuştur.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 aylık dönemde BIST Sınai Endeksinde yaklaşık **%4** **değer kaybı gözlenmiştir.**

Bu hafta **50** Bir hafta önce **50** Bir ay önce **33**

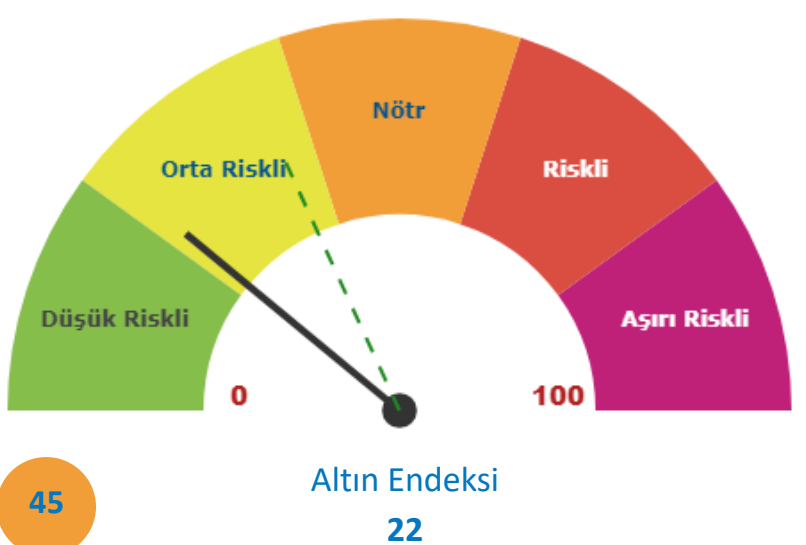


## ALTIN

Altın modeli 1 ayda düşük riskli yöne ilerleyerek nötr bölgeden **orta riskli** bölgeye geçiş yapmış ve bu hafta da düşük riskli yöne ilerleyişini sürdürmüştür.

Model düşük riskli yöne ilerlerken Altın fiyatları 1 haftada yaklaşık **%2**, 1 ayda ise yaklaşık **%3** **değer kazanmıştır.**

Bu hafta **22** Bir hafta önce **36** Bir ay önce **45**



# RİSKOMETRE

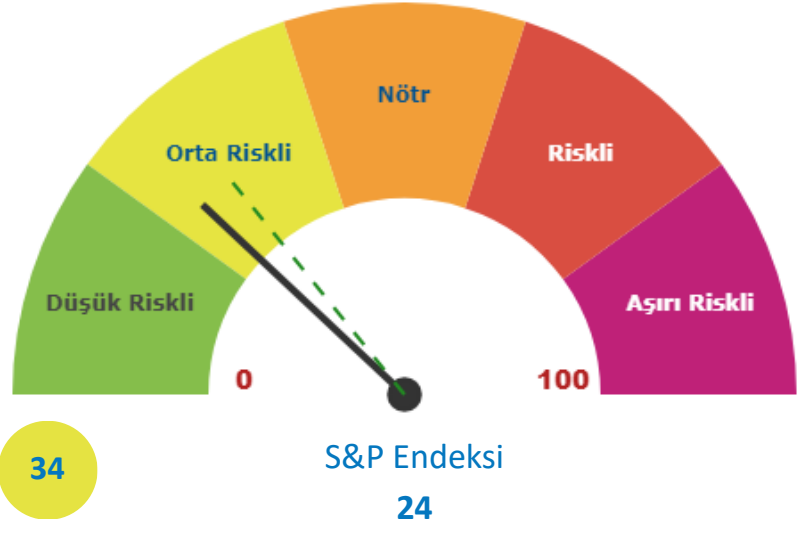
S&P

18 - 24 Aralık 2023

ABD Hisse Senedi modeli 1 aylık ve 1 haftalık dönemde **orta riskli** bölge içinde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftalık dönemde S&P Endeksinde yaklaşık **%2.5**, 1 ayda ise yaklaşık **%5** getiri gözlenmiştir.

Bu hafta **24** Bir hafta önce **28** Bir ay önce **34**

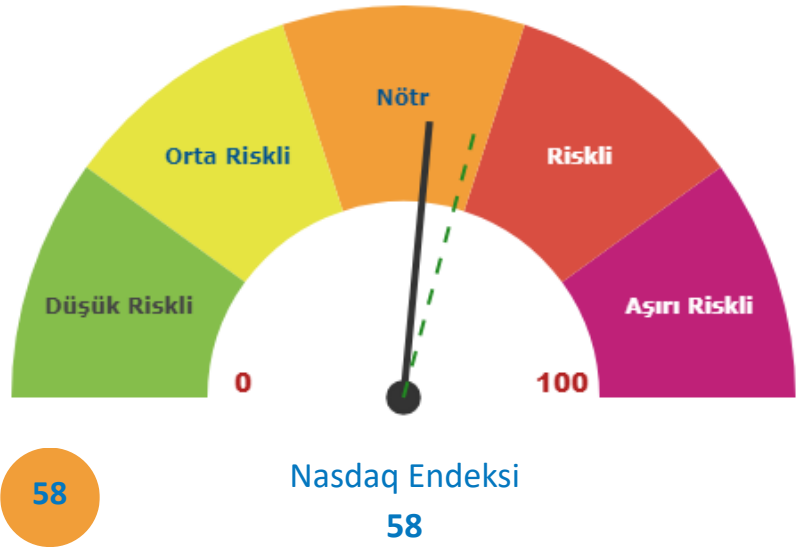


## NASDAQ

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

Modelin 1 haftalık düşük riskli yönde hareketi ile aynı dönemde NASDAQ Endeksi yaklaşık **%3**, 1 aylık dönemde ise yaklaşık **%4.5** değer kazanmıştır.

Bu hafta **53** Bir hafta önce **58** Bir ay önce **58**

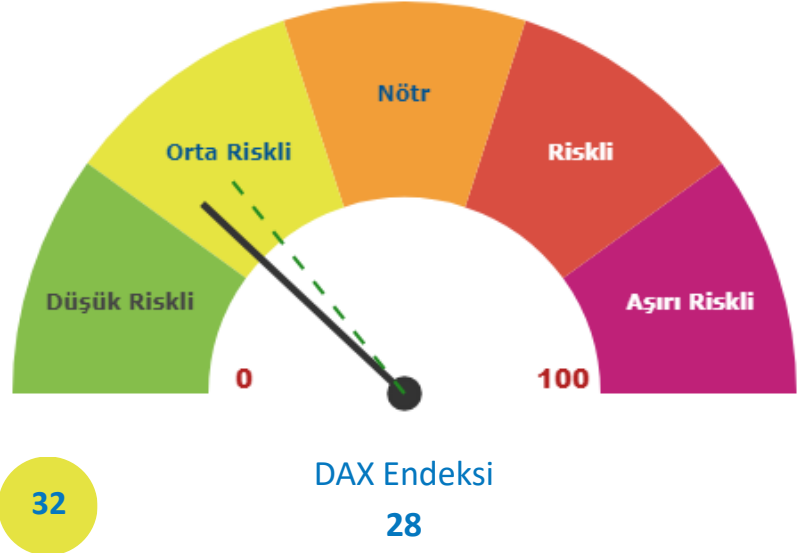


## DAX

Almanya Hisse Senedi modeli 1 aylık dönemde **orta riskli** bölge içinde yer alırken bu hafta da düşük riskli yönde hareketini sürdürmüştür.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada DAX Endeksinde yaklaşık **%1**, 1 ayda ise yaklaşık **%5** getiri gözlenmiştir.

Bu hafta **24** Bir hafta önce **28** Bir ay önce **32**

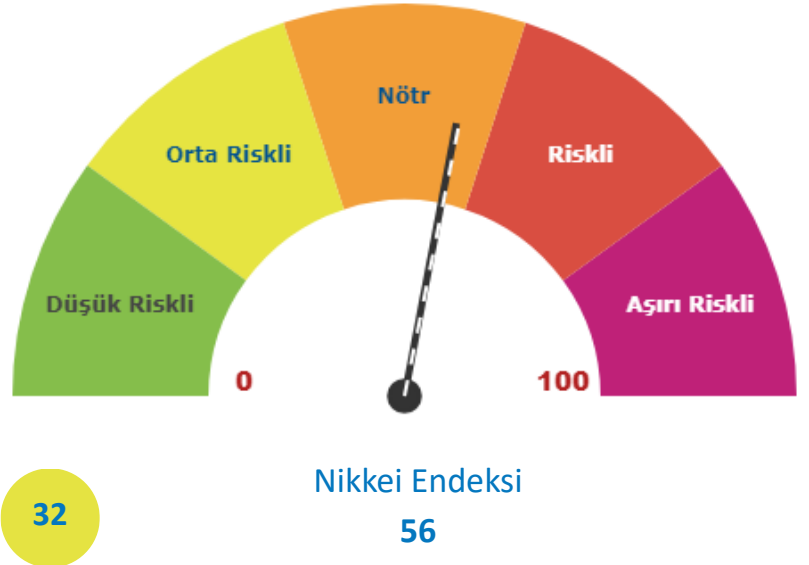


## NIKKEI

1 aylık dönemde orta riskli bölgeden **nötr** bölgeye geçiş yapan Japonya Hisse Senedi modeli bu hafta konumunu korumuştur.

Modelin 1 aylık riskli yönde hareketi ile aynı dönemde Nikkei Endeksinde yaklaşık **%2** değer kaybı gözlenmiştir.

Bu hafta **56** Bir hafta önce **56** Bir ay önce **32**

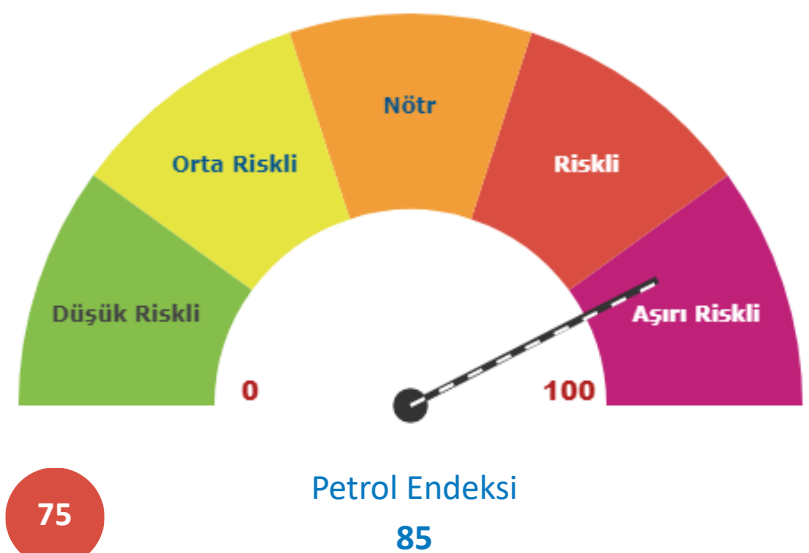


## PETROL

Petrol modeli geçen hafta geçiş yaptığı **aşırı riskli** bölgede yatay seyrini korumuştur.

Modelin 1 ayda riskli bölgeden aşırı riskli bölgeye geçtiği dönemde Petrol fiyatlarında yaklaşık **%5** değer kaybı gözlenmiştir.

Bu hafta **85** Bir hafta önce **85** Bir ay önce **75**



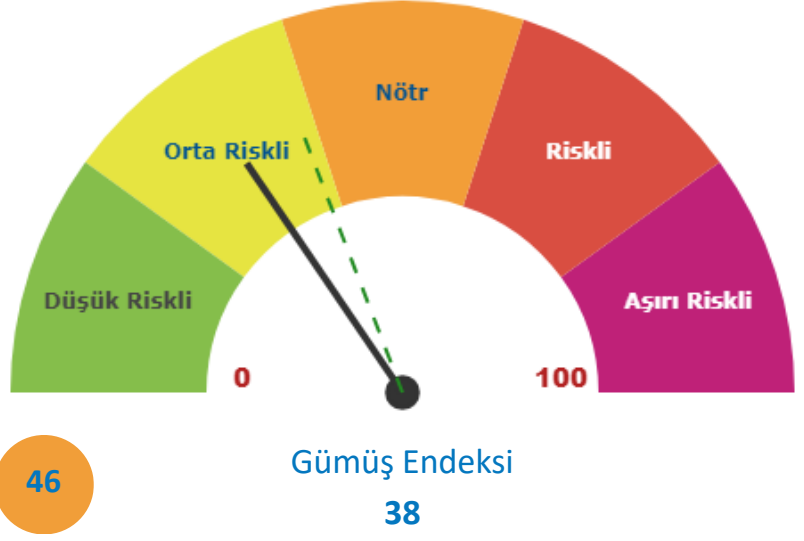
# RİSKOMETRE

## GÜMÜŞ

18 - 24 Aralık 2023

Gümüş modeli 1 ayda nötr bölgeden orta riskli bölgeye geçiş yaparken, bu hafta **orta riskli** bölge içinde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

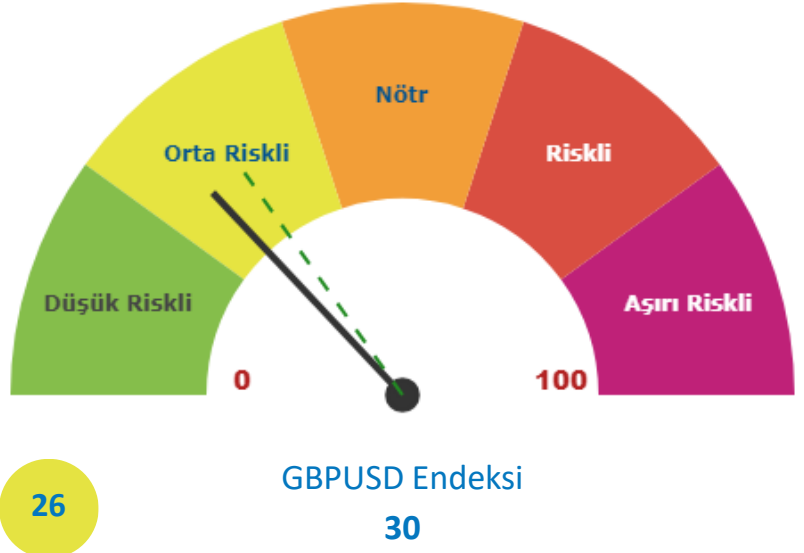
Modelin oynak bir dönem geçirdiği 1 ayda Gümüş fiyatları yaklaşık **%4**, 1 haftada ise yaklaşık **%5 getiri sağlamıştır**.



## GBPUSD

GBPUSD modeli bu hafta bulunduğu **orta riskli** bölge içinde düşük riskli yöne ilerleyerek 1 ay önceki konumuna dönüş yapmıştır.

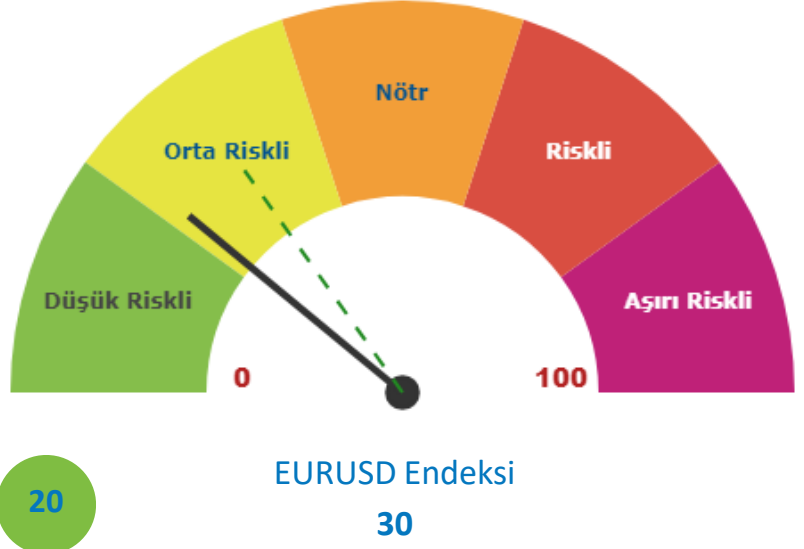
Modelin oynak hareket sergilediği 1 ayda GBPUSD paritesi yaklaşık **%2.5**, düşük riskli yöne ilerlediği bu hafta ise yaklaşık **%2 değer kazanmıştır**.



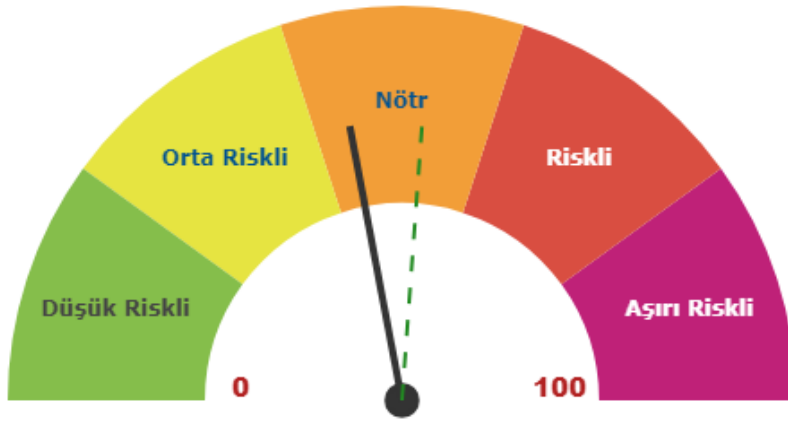
## EURUSD

Geçtiğimiz hafta **orta riskli** bölge ortasına ilerleyen EURUSD modeli bu hafta düşük riskli yöne dönüş yapmıştır.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği bu hafta EURUSD paritesi yaklaşık **%2 değer kazanmıştır**.



## 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](http://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."