

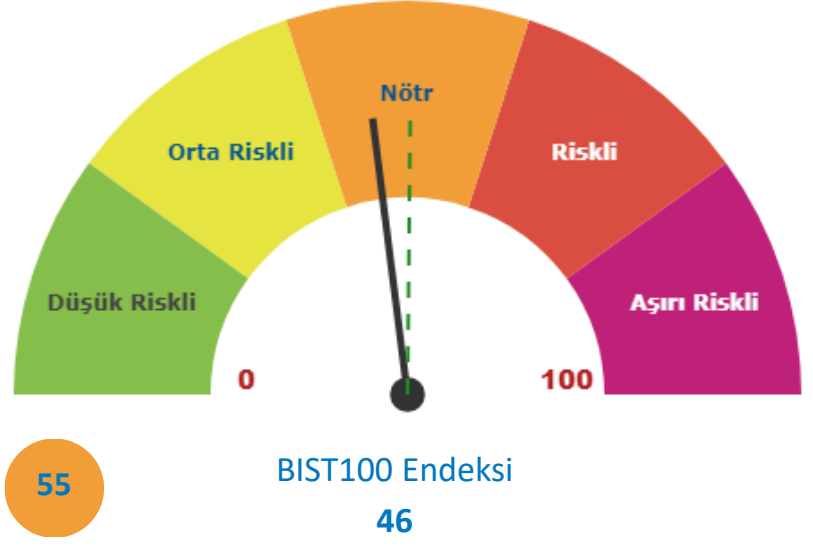
RİSKOMETRE

BIST100

20 - 26 Kasım 2023

BIST100 modeli **nötr** bölge içinde düşük riskli yönde hareketini sürdürüyor.

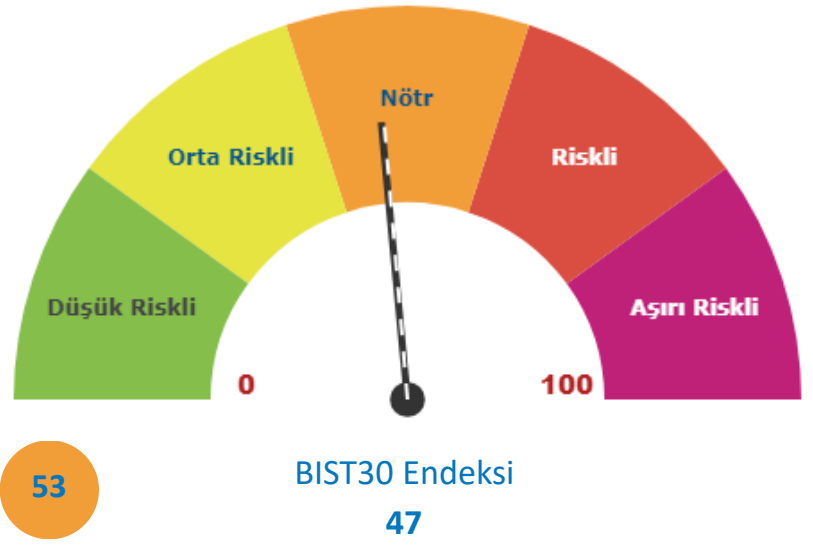
Modelin 1 aylık düşük riskli yöndeki hareketi ile aynı dönemde BIST100 Endeksinde yaklaşık **%4.5 getiri** gözlenmiştir.



Bu hafta **46** Bir hafta önce **50** Bir ay önce **55**

BIST30

BIST30 Modeli 1 aylık ve 1 haftalık dönemde **nötr** bölgede yer alırken, modelin 1 aylık düşük riskli yönde hareketi sırasında BIST30 Endeksi yaklaşık **%5.5 getiri sağlamıştır**.

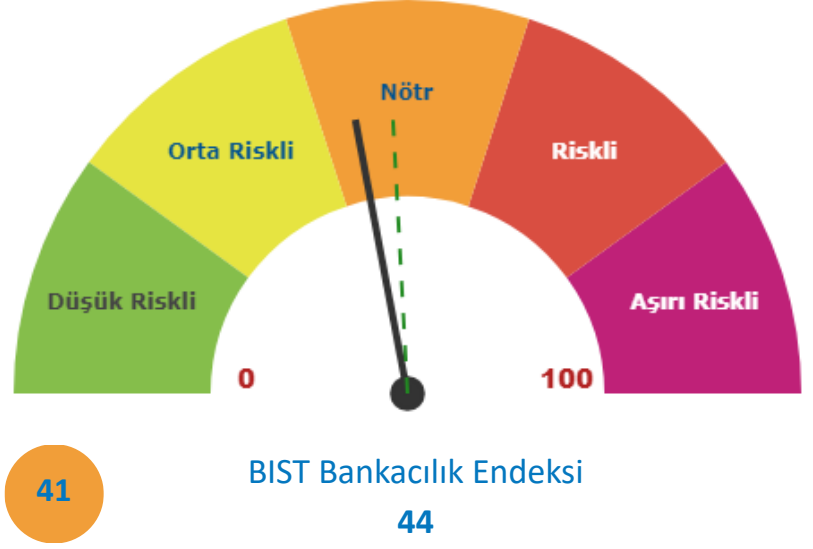


Bu hafta **47** Bir hafta önce **47** Bir ay önce **53**

BIST BANKACILIK

Geçtiğimiz hafta **nötr** bölge içinde riskli bölge sınırına yaklaşan BIST Bankacılık Modeli bu hafta yönünü düşük riskli yöne çevirmiştir.

Modelin 1 haftalık bu hareketi ile aynı dönemde BIST Bankacılık Endeksi yaklaşık **%1.5 değer kazanmıştır**.

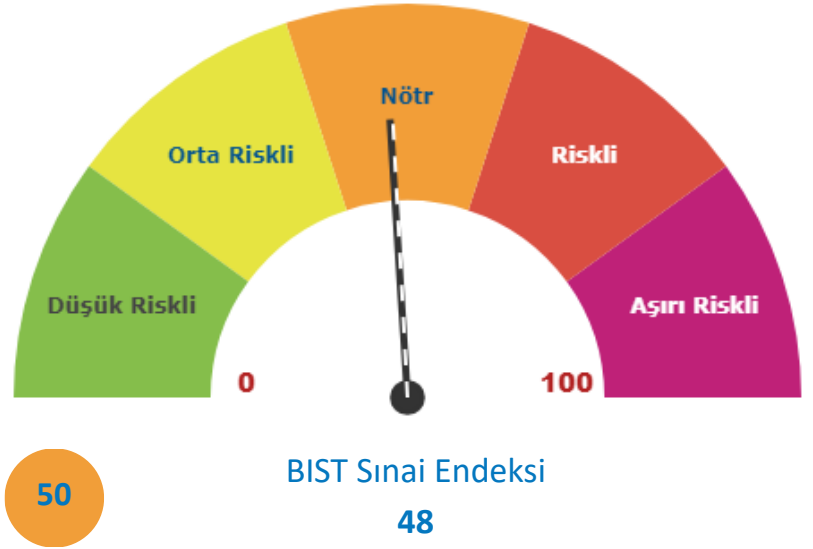


Bu hafta **44** Bir hafta önce **48** Bir ay önce **41**

BIST SINAI

BIST Sınai Endeksi 1 ay önce geçiş yaptığı **nötr** bölge içinde düşük riskli yöne ilerlerken, bu hafta konumunu korumaktadır.

Modelin 1 aylık düşük riskli yönde hareketi ile aynı dönemde BIST Sınai Endeksinde yaklaşık **%4 getiri** gözlenmiştir.

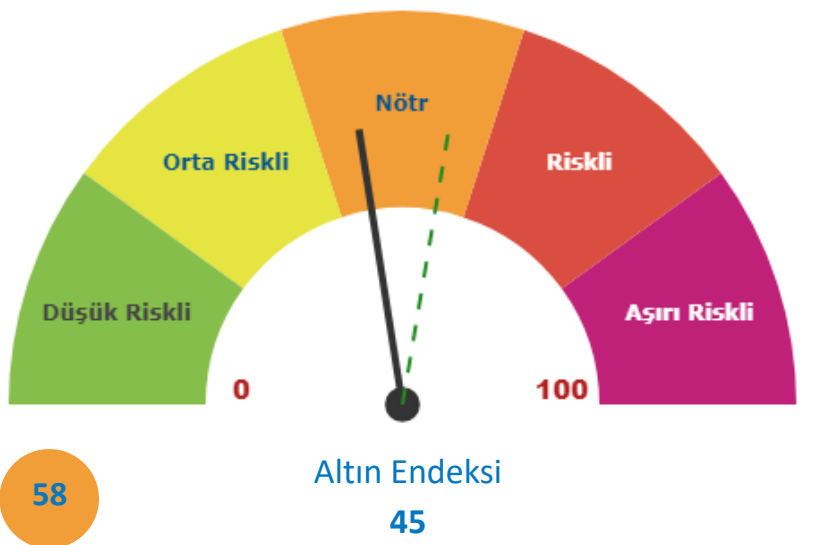


Bu hafta **48** Bir hafta önce **48** Bir ay önce **50**

ALTIN

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

Model hareketli bir dönem geçirirken Altın fiyatları, 1 ayda stabil kalmış 1 haftada ise yaklaşık **%2.5 getiri sağlamıştır**.



Bu hafta **45** Bir hafta önce **55** Bir ay önce **58**

RİSKOMETRE

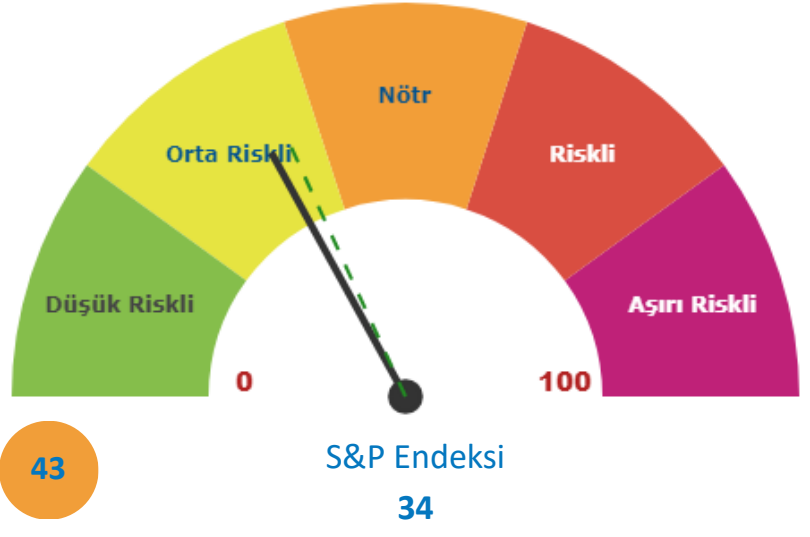
S&P

20 - 26 Kasım 2023

ABD Hisse Senedi modeli 1 ay önce bulunduğu nötr bölgeden **orta riskli** bölgeye geçiş yaparak bu hafta da düşük riskli yönde ilerlemiştir.

Modelin 1 aylık hareketi sırasında S&P Endeksi yaklaşık **%6.5**, 1 haftada ise **%2.5 getiri sağlamıştır**.

Bu hafta **34** Bir hafta önce **36** Bir ay önce **43**

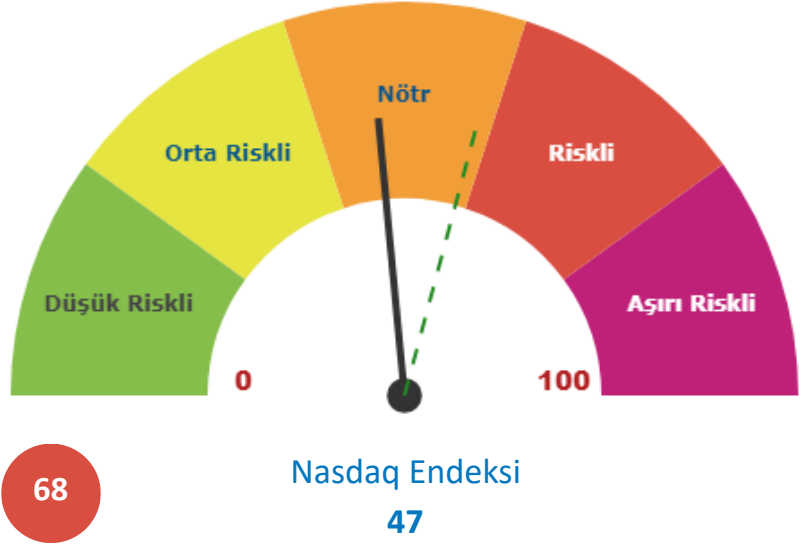


NASDAQ

NASDAQ Modeli 1 ay önceki riskli konumundan **nötr** bölgeye geçiş yaparken bu hafta düşük riskli yönde hareketini sürdürmüştür.

Modelin 1 haftalık düşük riskli yöndeki hareketi ile NASDAQ Endeksi yaklaşık **%4.5**, 1 aylık hareketi sırasında ise yaklaşık **%8.5 getiri sağlamıştır**.

Bu hafta **47** Bir hafta önce **58** Bir ay önce **68**

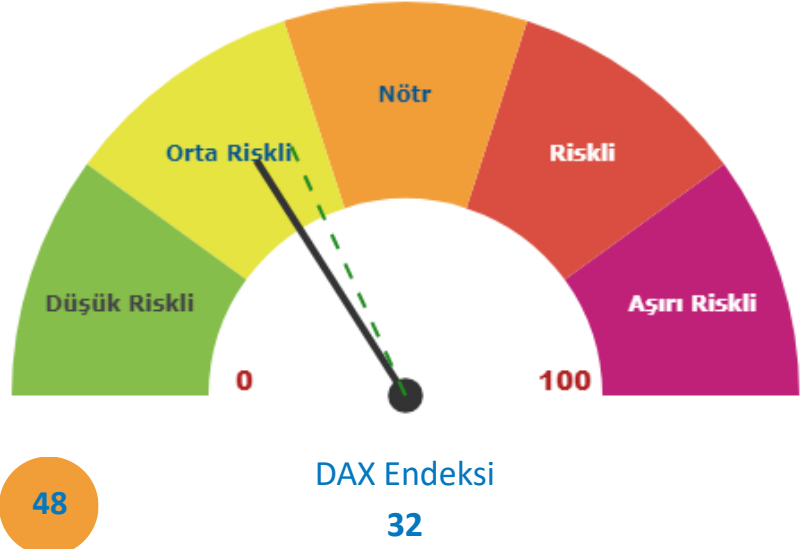


DAX

Almanya Hisse Senedi geçen hafta geçiş yaptığı **orta riskli** bölge içinde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin 1 haftalık düşük riskli hareketi sırasında DAX Endeksi yaklaşık **%4.5 değer kazanırken**, 1 ayda yaklaşık **%8 değer kazanmıştır**.

Bu hafta **32** Bir hafta önce **36** Bir ay önce **48**

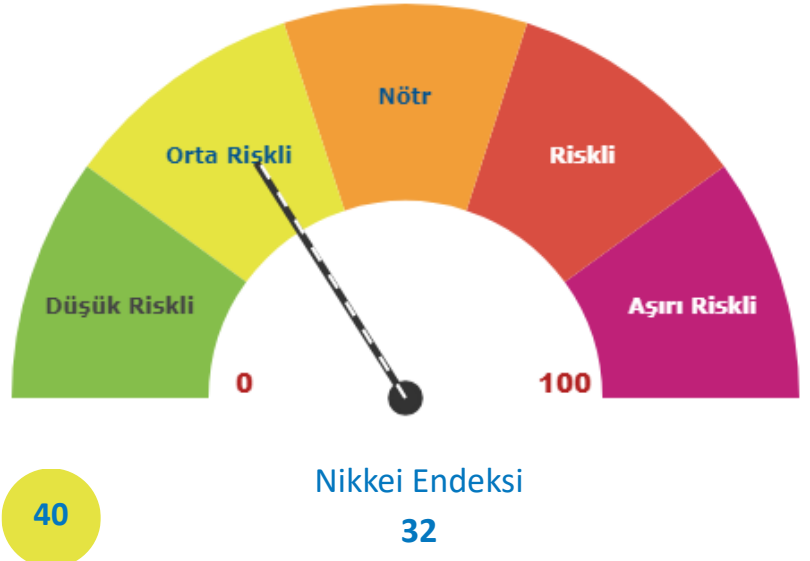


NIKKEI

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

Modelin 1 aylık hareketi ile aynı dönemde Nikkei Endeksinde yaklaşık **7.5 getiri gözlenmiştir**.

Bu hafta **32** Bir hafta önce **32** Bir ay önce **40**

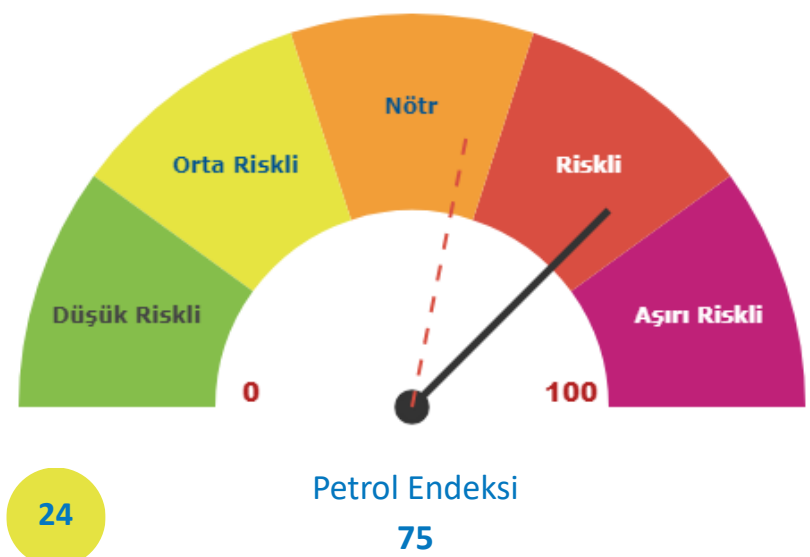


PETROL

Geçtiğimiz hafta bulunduğu orta riskli bölgeden nötr bölgeye geçiş yapan Petrol Modeli bu hafta **riskli** bölgeye ilerlemiştir.

Modelin 1 haftalık riskli yönde hareketi sırasında Petrol fiyatları yaklaşık **%4**, 1 ayda ise yaklaşık **%15 değer kaybı yaşamıştır**.

Bu hafta **75** Bir hafta önce **56** Bir ay önce **24**



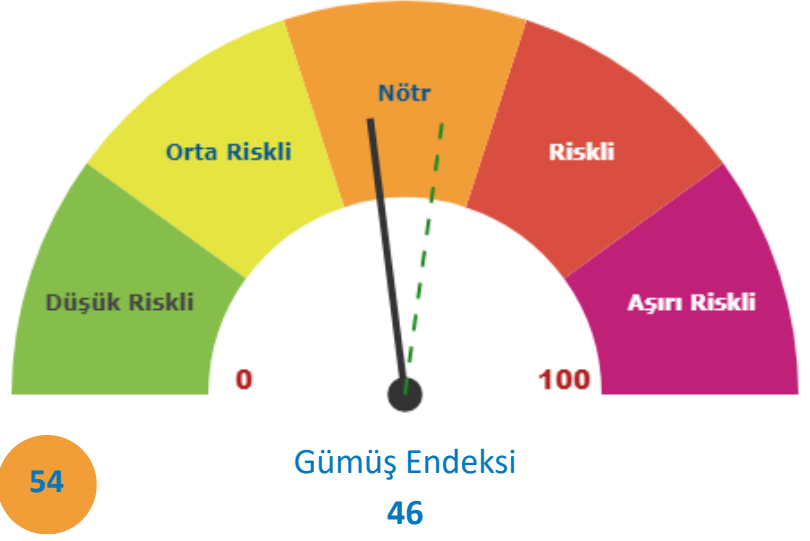
RİSKOMETRE

GÜMÜŞ

20 - 26 Kasım 2023

Gümüş Modeli 1 aydır **nötr** bölge içinde yer alırken bu hafta düşük riskli yöne ilerlemiştir.

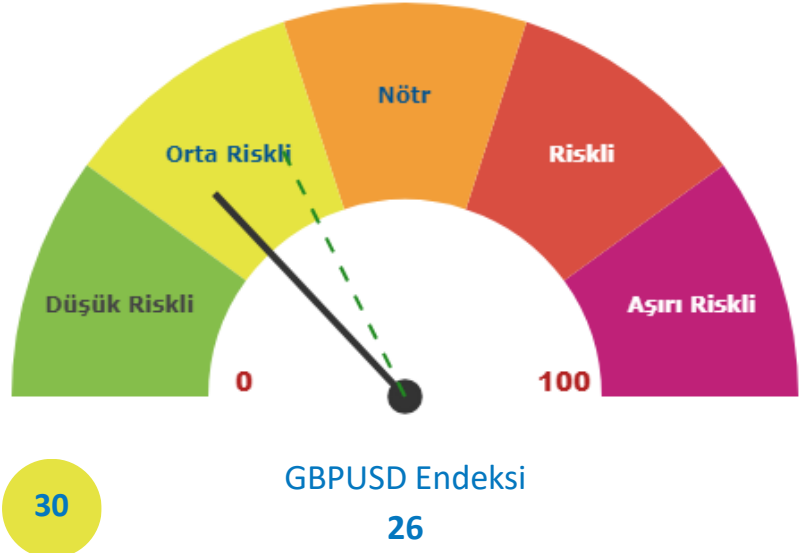
Modelin bu hareketi ile aynı dönemde Gümüş fiyatları yaklaşık **%8.5 değer kazanmıştır**.



GBPUSD

GBPUSD modeli 1 ayda, **orta riskli** bölge içinde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

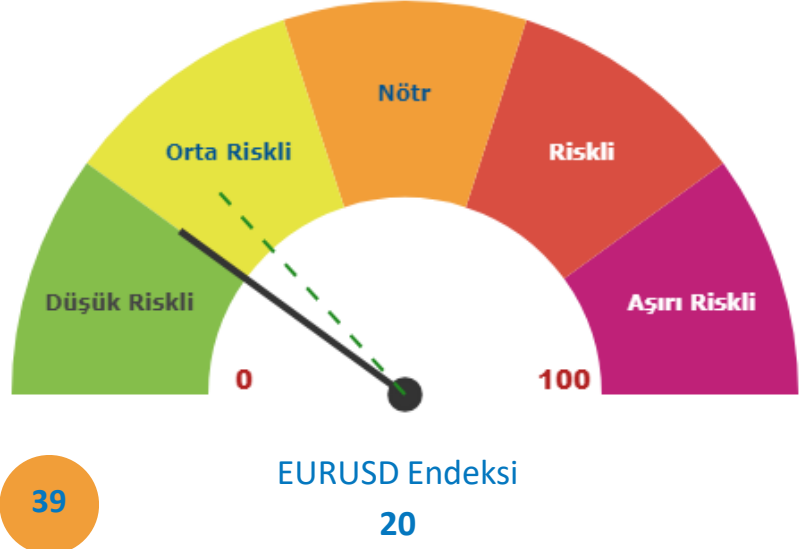
GBPUSD paritesi 1 ayda yaklaşık **%2.5 değer kazanmıştır**.



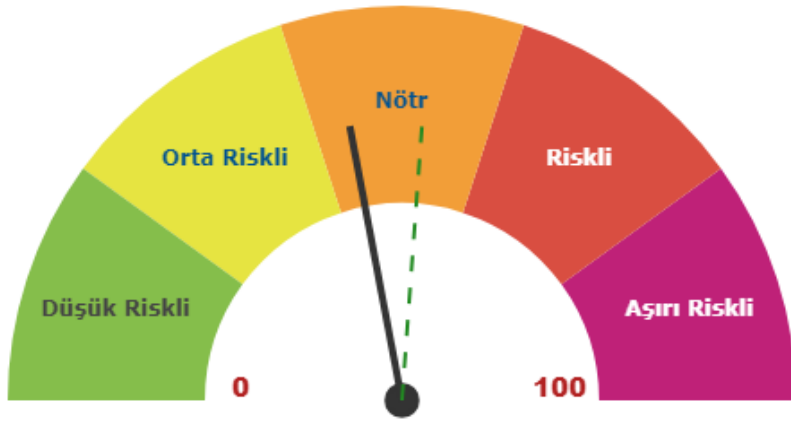
EURUSD

EURUSD modeli geçtiğimiz hafta orta riskli bölgeyi test ederek bu hafta **düşük riskli** bölgeye yapmıştır.

Modelin 1 haftalık hareketi sırasında EURUSD paritesi yaklaşık **%1.5**, 1 aylık hareketi sırasında ise yaklaşık **%2.5 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

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."