

RİSKOMETRE

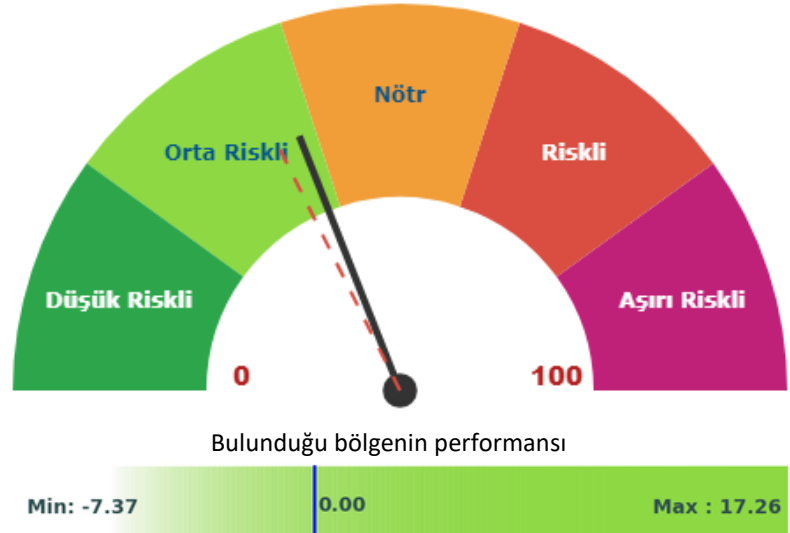
BIST100

1 - 7 Nisan 2024

Hafta ortasında nötr bölgeyi test eden BIST100 modeli 1 haftada **orta riskli bölge** içinde riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin orta risk sinyali verdiği 1 ayda BIST100 endeksi getirisi %5 bandında dalgalı seyretmiş ve endeks getirisi 1 ay önceye göre sabit kalmıştır.

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

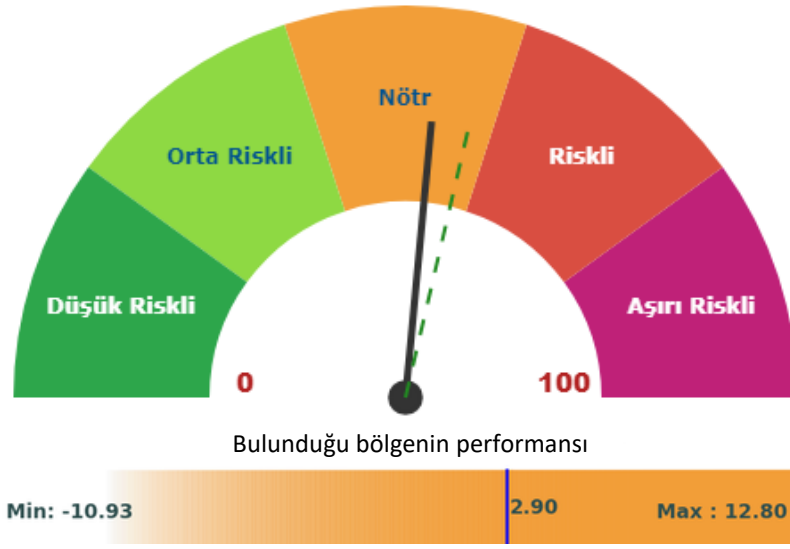


BIST30

BIST30 modeli bu hafta yaklaşık 1 ay önce geçiş yaptığı **nötr bölge** içinde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada BIST30 Endeksi yaklaşık **%1 değer kazanırken**, model nötr bölgeye girdiği andan itibaren endeks getirisi **tarihsel ortalamasının üzerine ulaşmıştır**.

Bu hafta **53** Bir hafta önce **57** Bir ay önce **39**

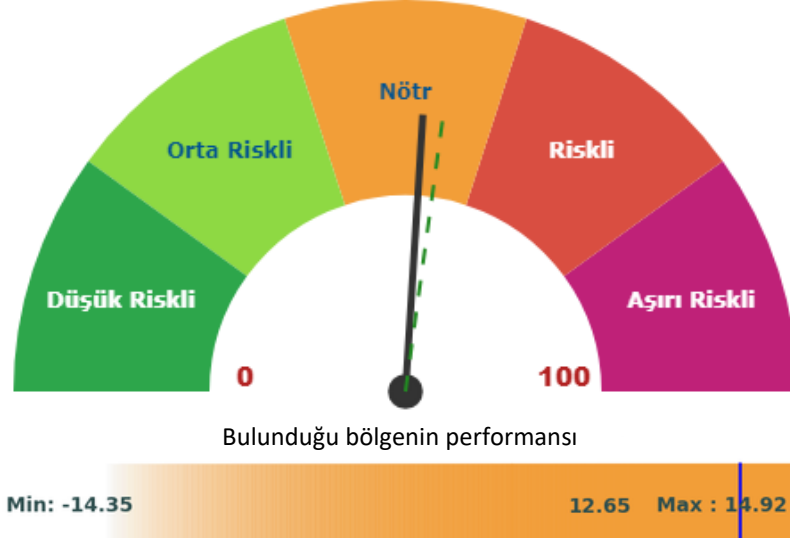


BIST BANKACILIK

BIST Bankacılık Endeksi modeli yaklaşık 1 aydır **nötr bölge** içinde yer alırken bu hafta düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Model 2 haftada düşük riskli yöne ilerlerken BIST Bankacılık Endeksi yaklaşık **%2.5 değer kazanmıştır**. Model nötr bölgeye girdiğinden beri endeks getirisi **%12.65** olurken bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının maksimum sınırına yaklaşmıştır**.

Bu hafta **52** Bir hafta önce **54** Bir ay önce **39**

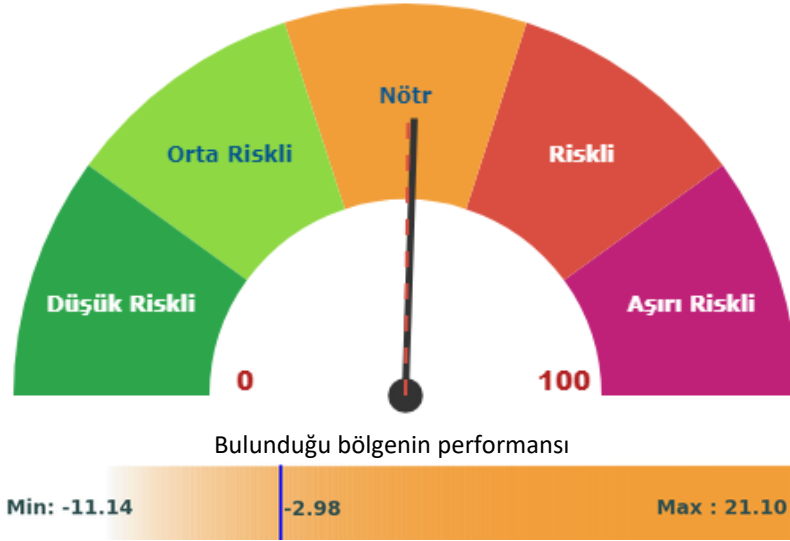


BIST SINAI

1 aylık dönemde riskli yöne ilerleyen BIST Sınai Endeksi modeli bu hafta bulunduğu **nötr bölge** içinde riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 aylık dönemde BIST Sınai Endeksi yaklaşık **%4 değer kaybederken** nötr bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında bir performans sergilemiştir**.

Bu hafta **51** Bir hafta önce **50** Bir ay önce **38**

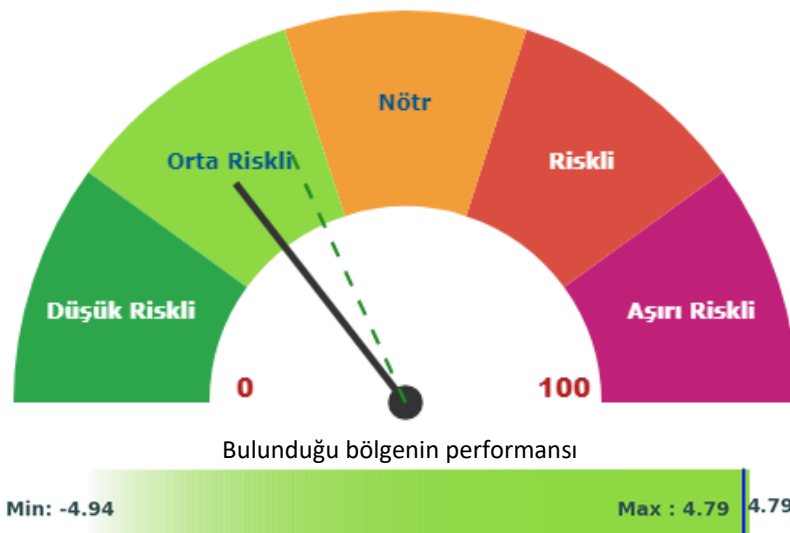


ALTIN

Altın modeli 1 haftalık ve 1 aylık dönemde düşük riskli yöne ilerlerken 3 haftadır **orta risk** sinyali vermektedir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda Altın fiyatları yaklaşık **%10 değer kazanırken** düşük riskli bölge içinde bulunduğu süre boyunca **getirisi tarihsel maksimum değerine ulaşmıştır**.

Bu hafta **29** Bir hafta önce **36** Bir ay önce **52**



RİSKOMETRE

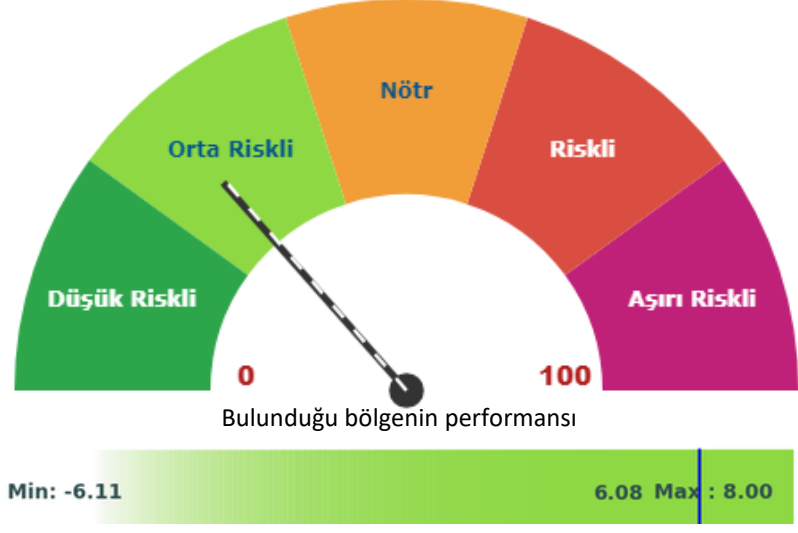
S&P

1 - 7 Nisan 2024

ABD Hisse Senedi modeli 1 aylık dönemde **orta riskli bölge** içinde bulunurken bu hafta 1 ay önceki konumuna dönüş yapmıştır.

Model, orta riskli bölgede geçirdiği ortalama sürenin üzerinde bu bölgede bulunurken, S&P Endeksi 1 ayda yaklaşık %3 değer kazanmış ve bölgeye girdiğinden beri bu bölgede sağladığı maksimum getiri miktarına yaklaşmıştır.

Bu hafta **27** Bir hafta önce **27** Bir ay önce **27**

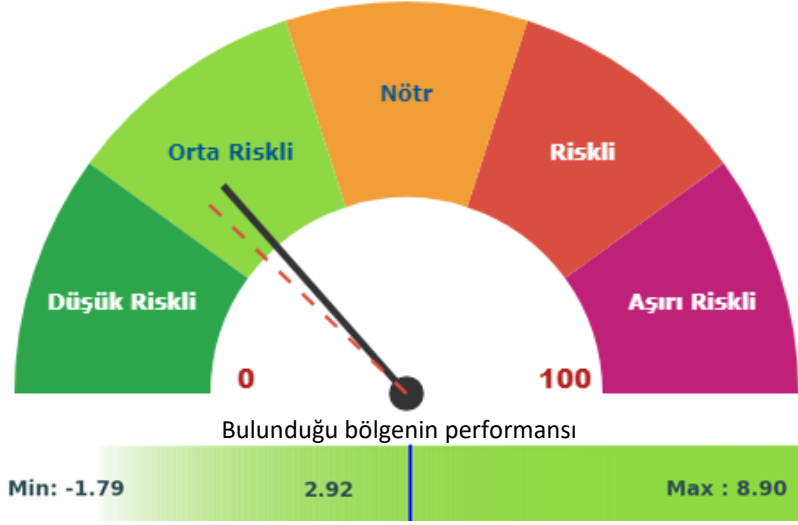


NASDAQ

NASDAQ modeli 1 haftalık ve 1 aylık dönemde **orta riskli bölge** içinde yer alırken bu hafta riskli yöne ilerlemiştir.

NASDAQ Endeksi, modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 aylık dönemde yaklaşık %1.5 getiri sağlamıştır. Model bu bölgede geçirdiği maksimum süreye ulaşırken getirisi bölgede sağladığı **tarihsel ortalamasının altında kalmıştır.**

Bu hafta **27** Bir hafta önce **24** Bir ay önce **31**

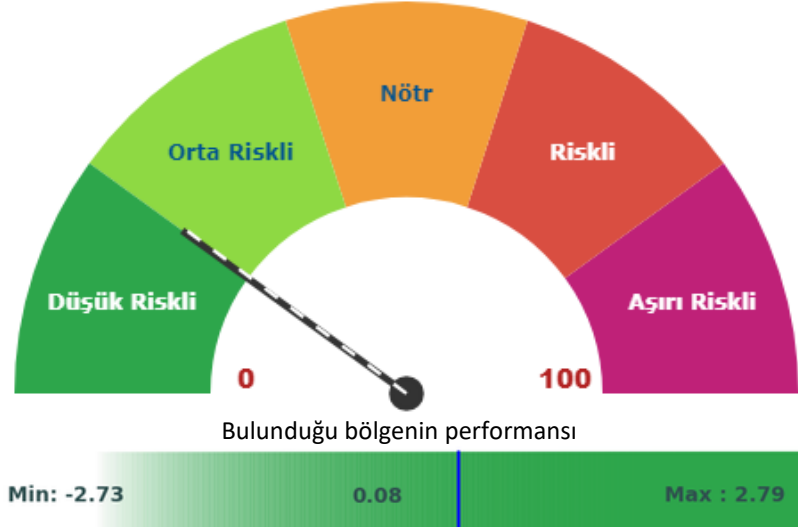


DAX

Hafta ortasında orta riskli bölgeyi test eden Almanya Hisse Senedi modeli **düşük riskli bölge** içinde 1 hafta önceki konumuna dönüş yapmıştır.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda DAX Endeksi yaklaşık %5 değer kazanmış ve düşük riskli bölgeye girdiğinden beri getirisi bölge ortalamasına ulaşmıştır.

Bu hafta **20** Bir hafta önce **20** Bir ay önce **24**

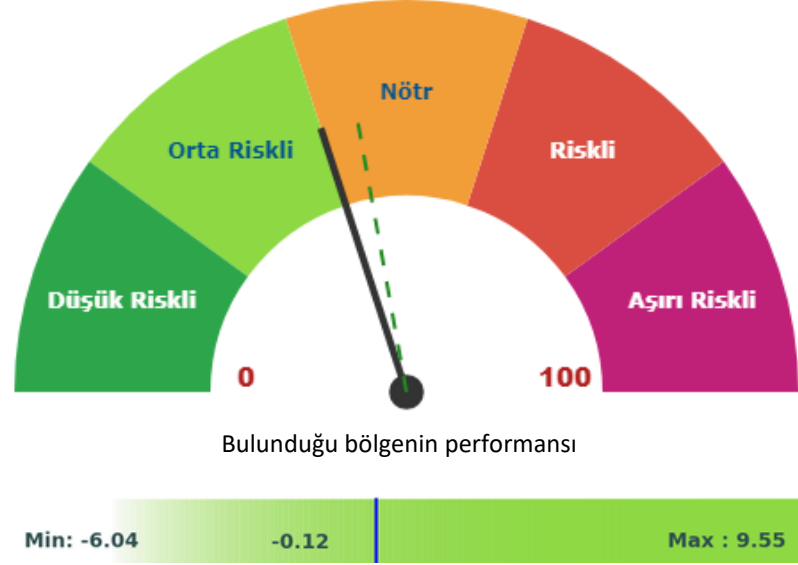


NIKKEI

Japonya Hisse Senedi modeli bu hafta yaklaşık 10 haftadır bulunduğu nötr bölgeden **orta riskli bölge** sınırına geçiş yapmıştır.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada Nikkei Endeksi yaklaşık %1.5, 1 ayda ise yaklaşık %3 getiri sağlamıştır.

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

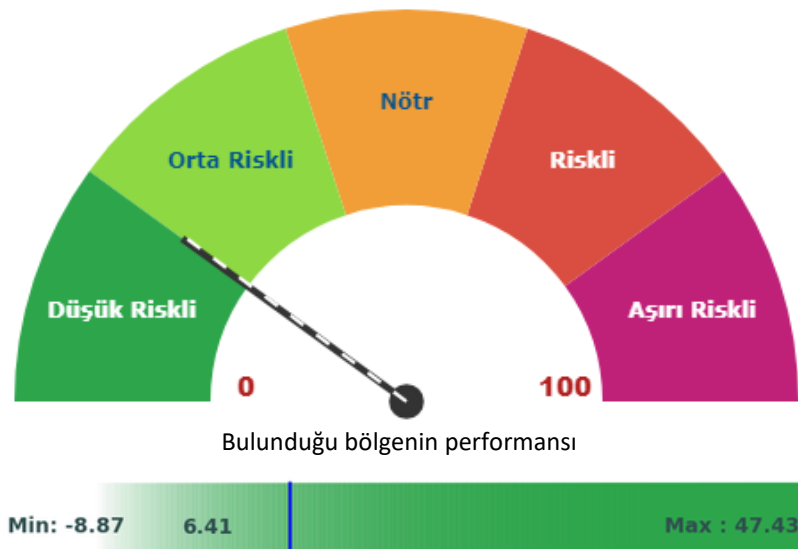


PETROL

Petrol modeli bu hafta **düşük riskli bölge** içinde konumunu korumuştur.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 aylık dönemde Petrol fiyatları yaklaşık %5 değer kazanmıştır. Model yaklaşık 3 haftadır düşük riskli bölgede yer alırken bölgeye girdiğinden beri getirisi **tarihsel ortalamasının altında bulunmaktadır.**

Bu hafta **20** Bir hafta önce **20** Bir ay önce **50**



RİSKOMETRE

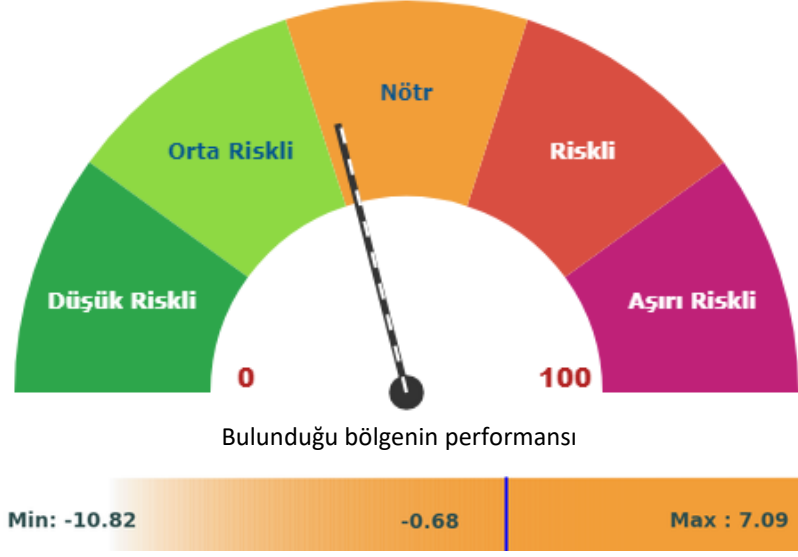
GÜMÜŞ

1 - 7 Nisan 2024

Hafta içinde orta riskli bölgeyi test eden Gümüş modeli bu **nötr bölge** içinde 1 hafta önceki konumuna dönüş yapmıştır.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda Gümüş fiyatları yaklaşık **%10 değer kazanmıştır**.

Bu hafta **42** Bir hafta önce **42** Bir ay önce **54**

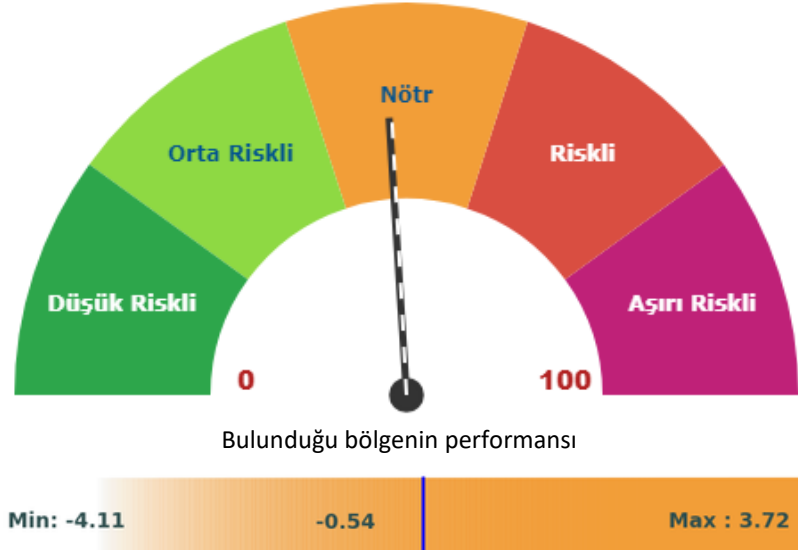


GBPUSD

GBPUSD modeli bu hafta bulunduğu **nötr bölge** içinde konumunu korumuştur.

Modelin nötr sinyal verdiği 1 ayda GBPUSD paritesi getirisi **%2 bandında dalgalı** seyrederken model bu bölge içinde sağladığı ortalama getiri değerine ulaşmıştır.

Bu hafta **48** Bir hafta önce **48** Bir ay önce **43**

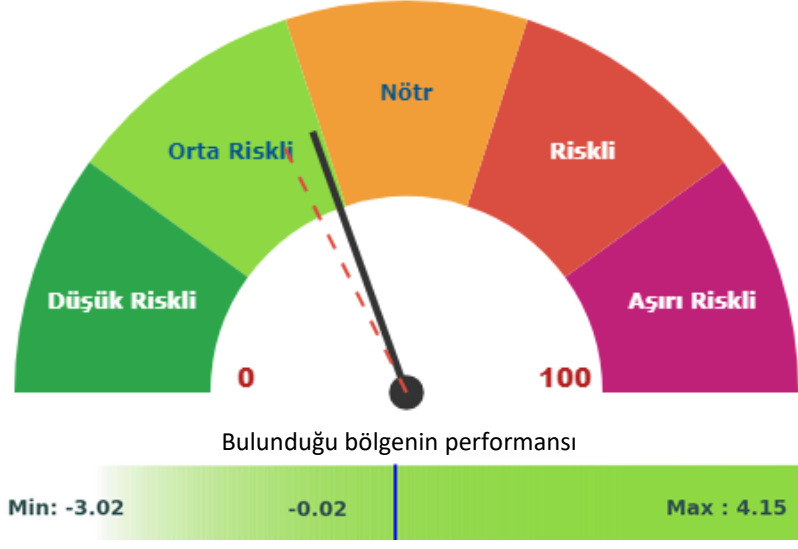


EURUSD

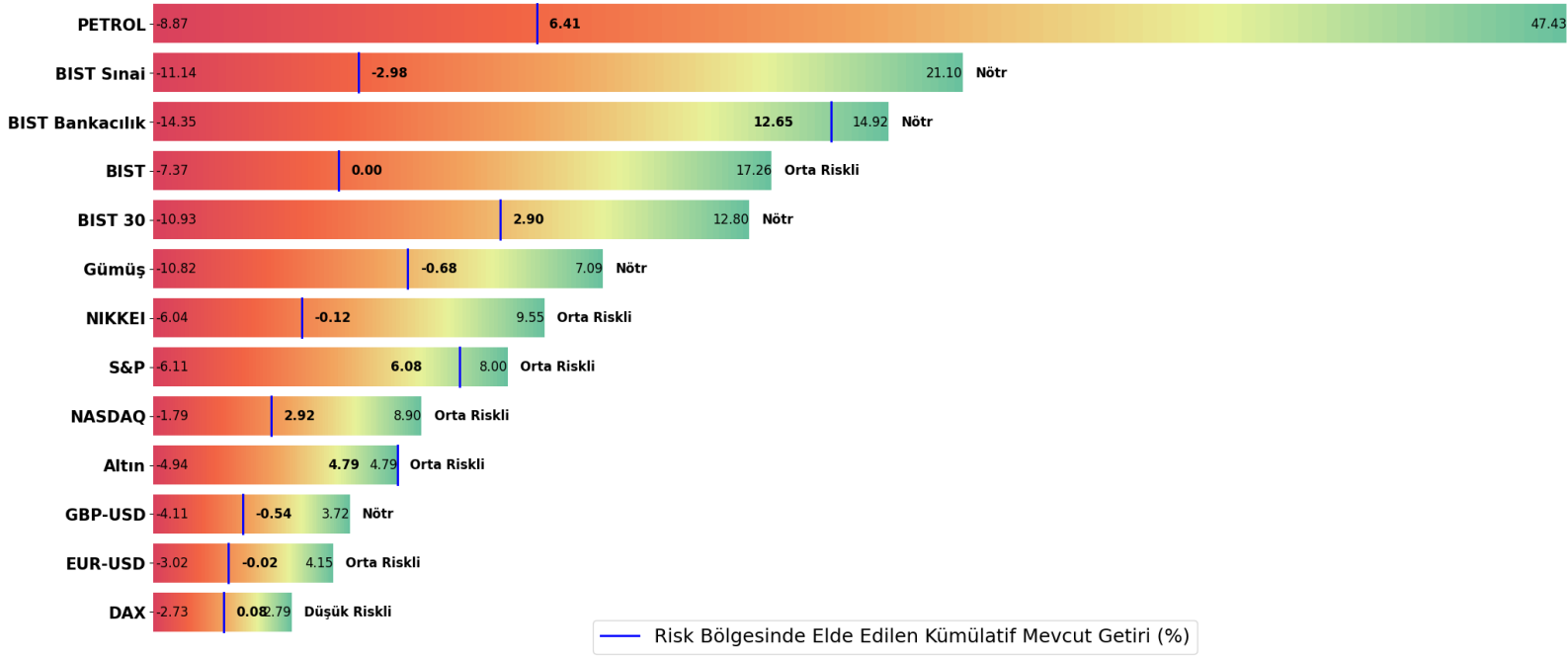
EURUSD modeli yaklaşık 1.5 ay boyunca bulunduğu **orta riskli bölge** içinde riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 ayda EURUSD paritesi yaklaşık **%0.5 değer kaybetmiştir**. Model orta riskli bölgeye girdiğinden beri getirisi tarihsel ortalamasının altında kalmıştır.

Bu hafta **39** Bir hafta önce **35** Bir ay önce **30**

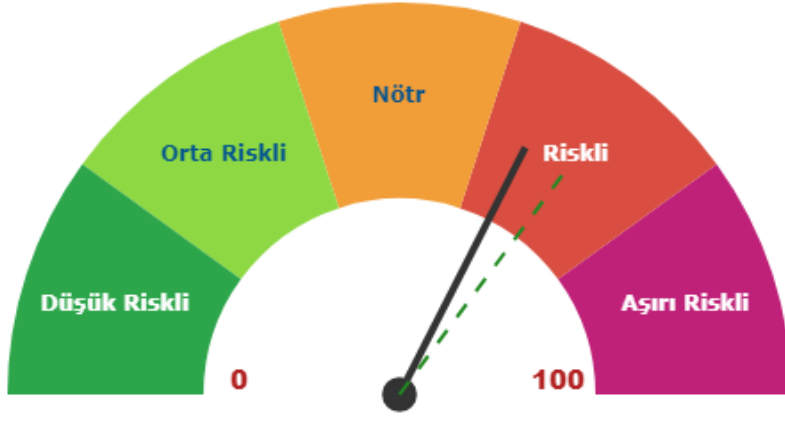


Bulunduğu Bölgeye Göre Getiri Bantları



*Grafikte sunulan veriler, ilgili varlık modelinin mevcut bulunduğu risk bölgesi içerisinde kaydedilen kümülatif minimum ve maksimum getiri oranlarını temsil etmektedir. 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:

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 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.”