

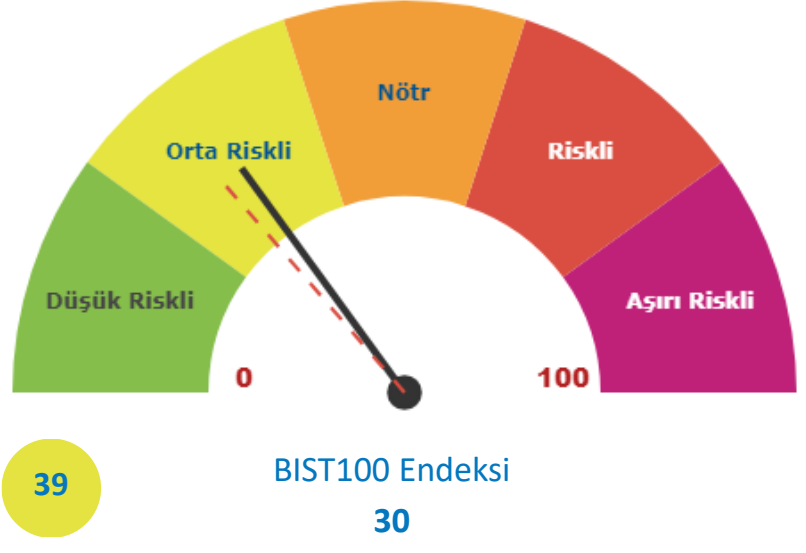
RİSKOMETRE

BIST100

25 - 31 Aralık 2023

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

Modelin oynak seyrederek nötr bölgeyi test ettiği 1 aylık dönemde BIST100 Endeksinde yaklaşık **%7**, riskli yöne ilerlediği bu hafta ise yaklaşık **%1.5 değer kaybı** gözlenmiştir.

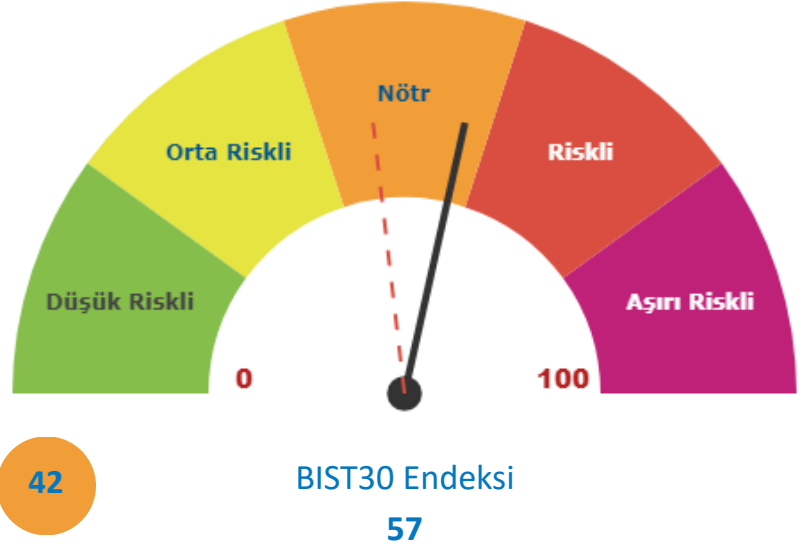


Bu hafta **30** Bir hafta önce **27** Bir ay önce **39**

BIST30

BIST30 modeli bu 1 aylık ve 1 haftalık dönemde bulunduğu **nötr** bölge içinde riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftalık dönemde BIST30 Endeksi yaklaşık **%3**, 1 aylık dönemde ise yaklaşık **%7 değer kaybı** yaşamıştır.

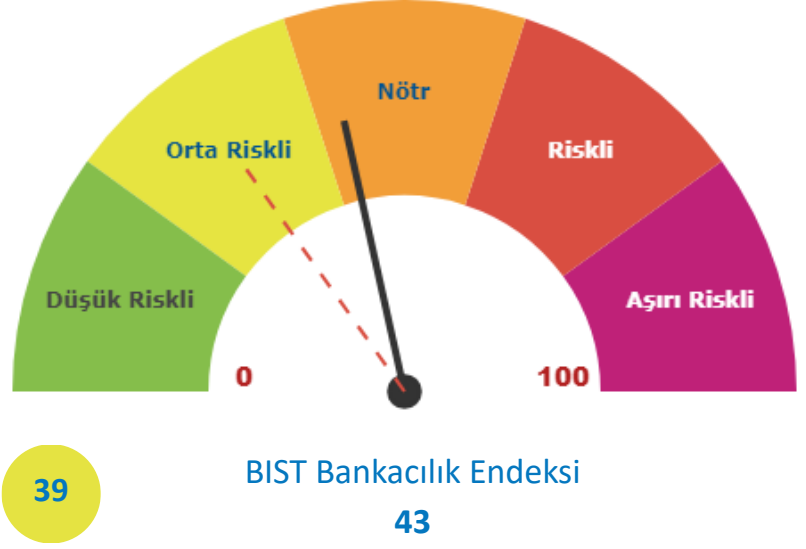


Bu hafta **57** Bir hafta önce **46** Bir ay önce **42**

BIST BANKACILIK

BIST Bankacılık modeli bu hafta 1 aydır bulunduğu orta riskli bölgeden **nötr** bölgeye geçiş yapmıştır.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftalık dönemde BIST Bankacılık Endeksi yaklaşık **%5.5** değer kaybı yaşamıştır.

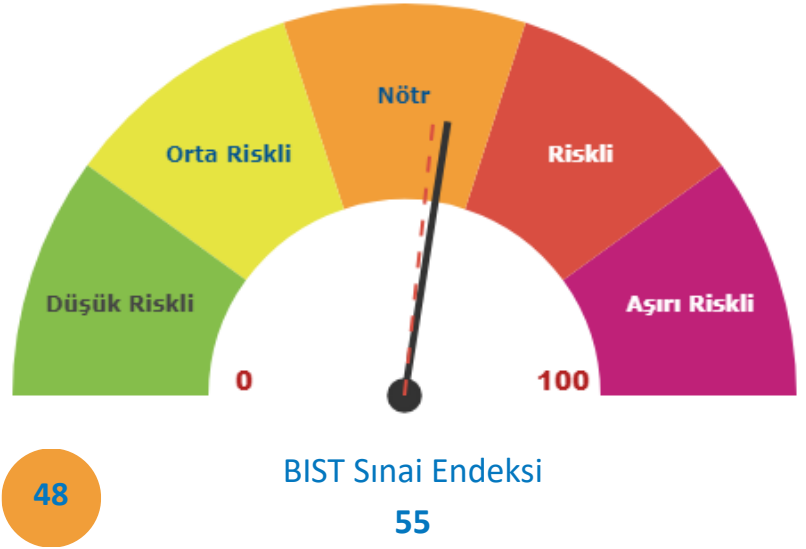


Bu hafta **43** Bir hafta önce **30** Bir ay önce **39**

BIST SINAİ

BIST Sınai Endeksi modeli 1 aylık ve 1 haftalık dönemde **nötr** bölge içinde riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftada BIST Sınai Endeksinde 1 haftada yaklaşık **%1**, 1 ayda ise yaklaşık **%11** **değer kaybı** gözlenmiştir.

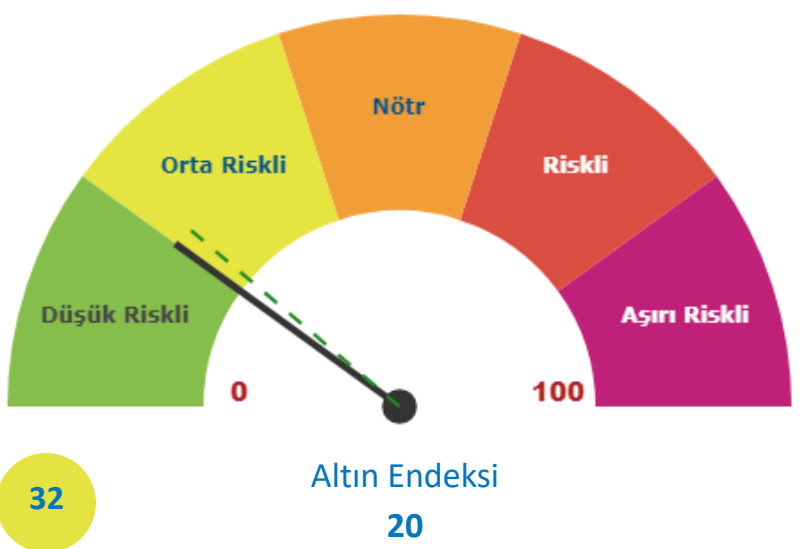


Bu hafta **55** Bir hafta önce **53** Bir ay önce **48**

ALTIN

Altın modeli bu hafta orta riskli bölgeden **düşük riskli** bölgeye geçiş yapmıştır.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada Altın fiyatları yaklaşık **%1**, 1 ayda ise yaklaşık **%1.5** **değer kazanmıştır**.



Bu hafta **20** Bir hafta önce **22** Bir ay önce **32**

RİSKOMETRE

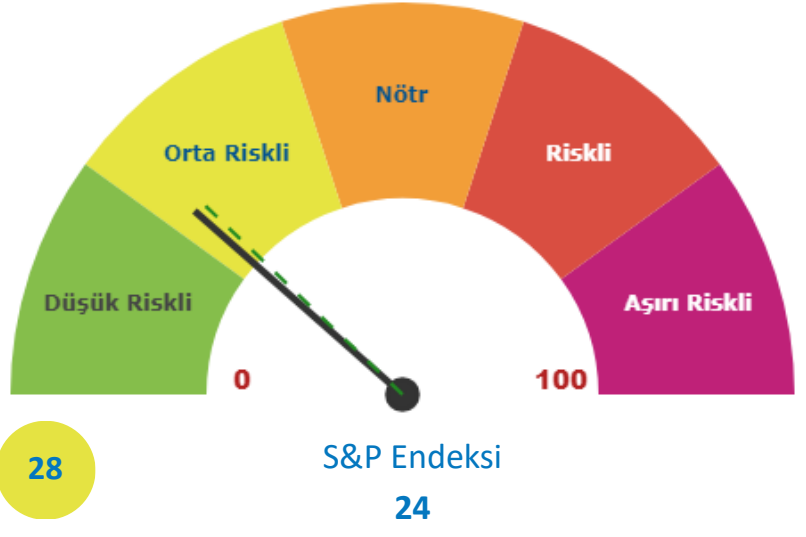
S&P

25 - 31 Aralık 2023

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

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada yaklaşık **%1**, 1 ayda ise S&P Endeksinde yaklaşık **%4.5** getiri gözlenmiştir.

Bu hafta **23** Bir hafta önce **24** Bir ay önce **28**

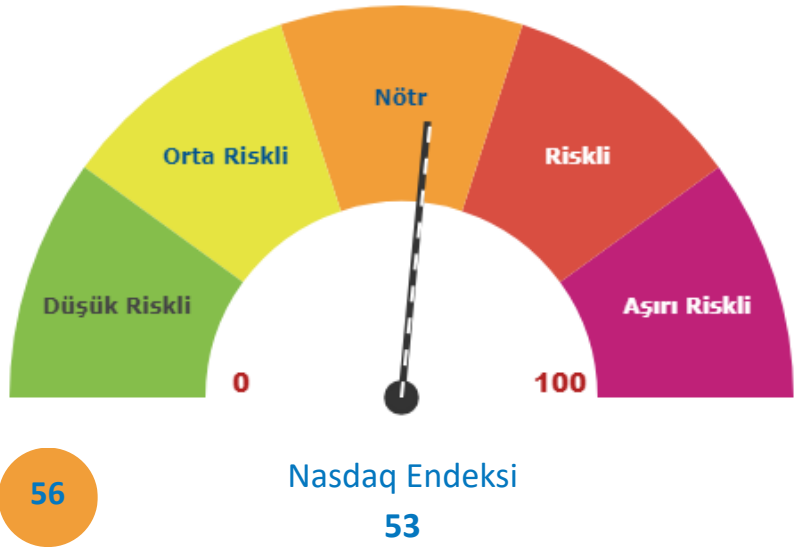


NASDAQ

NASDAQ modeli 1 aylık dönemde **nötr** bölge içinde düşük riskli yöne ilerlemiş, bu hafta ise stabil seyretmiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 aylık dönemde NASDAQ Endeksi yaklaşık **%5.5** değer kazanmıştır.

Bu hafta **53** Bir hafta önce **53** Bir ay önce **56**

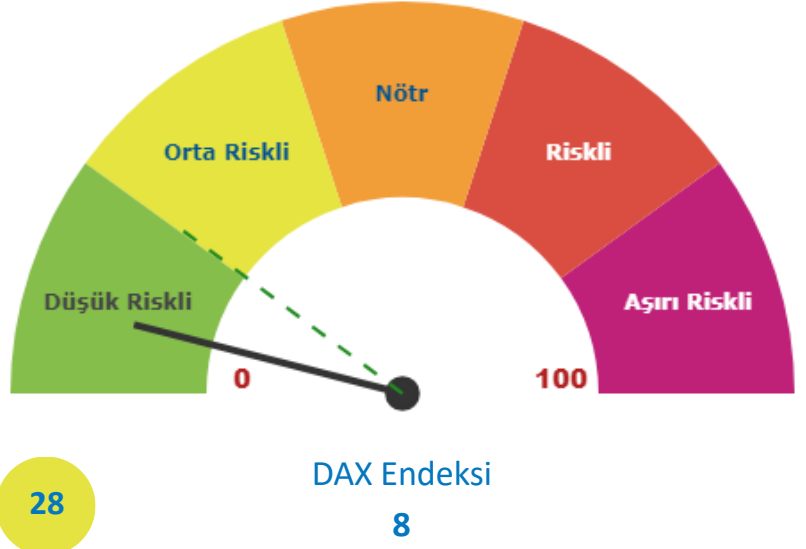


DAX

Almanya Hisse Senedi modeli bu hafta **düşük riskli** bölge içinde yine düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 aylık dönemde DAX Endeksinde yaklaşık **%2** getiri gözlenmiş, oynak seyrettiği 1 haftada getirisi stabil kalmıştır.

Bu hafta **8** Bir hafta önce **20** Bir ay önce **28**

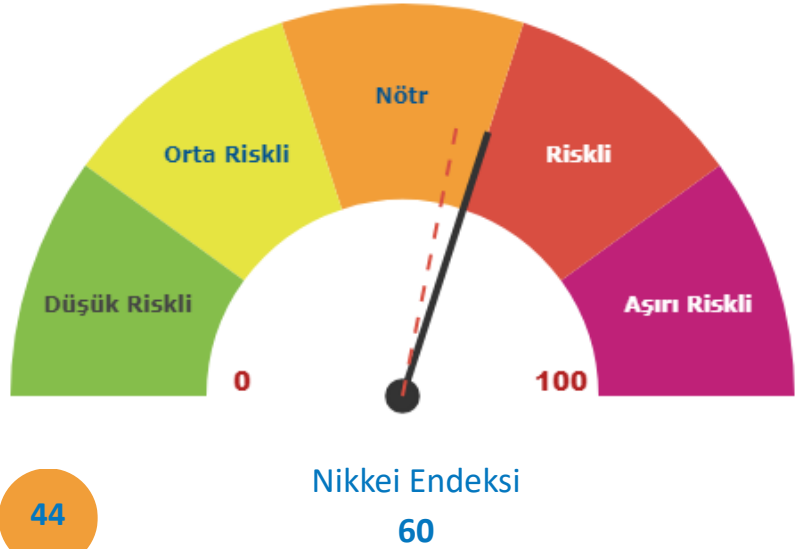


NIKKEI

1 aylık dönemde **nötr** bölgede yer alan Japonya Hisse Senedi modeli riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin bölge içinde oynak seyrettiği 1 ayda Nikkei Endeksinde yaklaşık **%1** değer kaybı gözlenmiştir.

Bu hafta **60** Bir hafta önce **56** Bir ay önce **44**

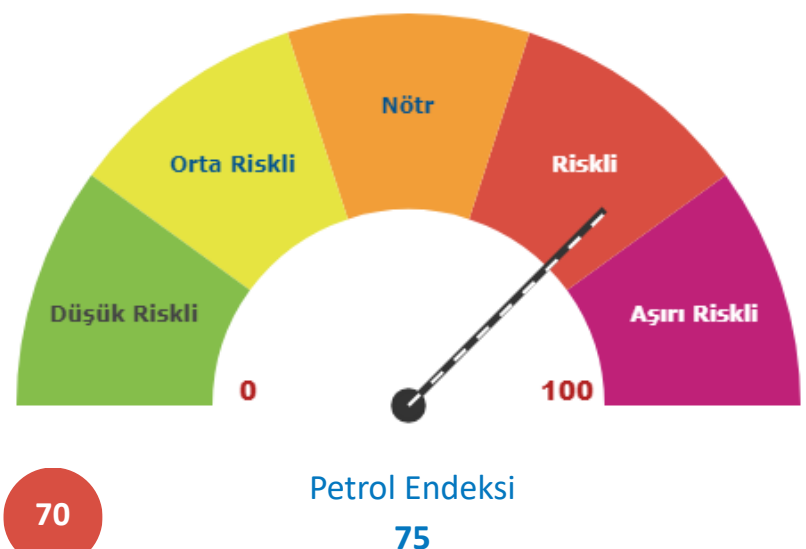


PETROL

Petrol modeli 1 aylık dönemde riskli yönde ilerlerken bu hafta stabil seyrini korumuştur.

Modelin **riskli** bölgede yer aldığı 1 haftada Petrol fiyatları yaklaşık **%2**, riskli yöne ilerlediği 1 aylık dönemde ise yaklaşık **%3.5** değer kazanmıştır.

Bu hafta **75** Bir hafta önce **75** Bir ay önce **70**



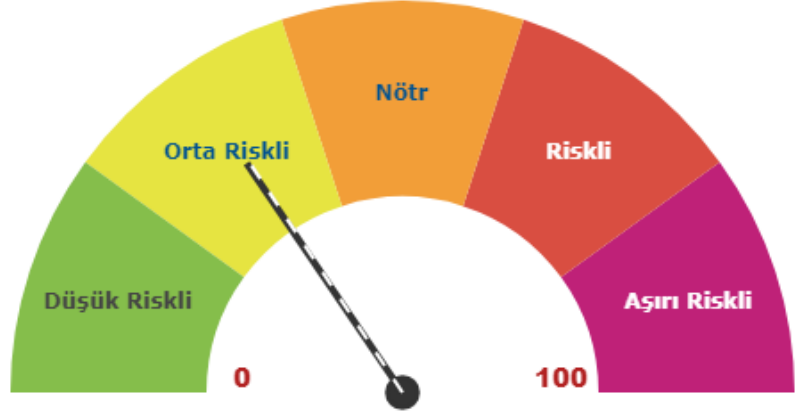
RİSKOMETRE

GÜMÜŞ

25 - 31 Aralık 2023

Bu ay oynak seyreden Gümüş modeli ay ortasında nötr bölgeyi test etmiş ve **orta riskli** bölge içinde 1 hafta önceki konumuna geri dönmüştür.

Modelin dalgalı hareket ettiği 1 aylık dönemde Gümüş fiyatları yaklaşık **%6 değer kaybı** yaşamıştır.



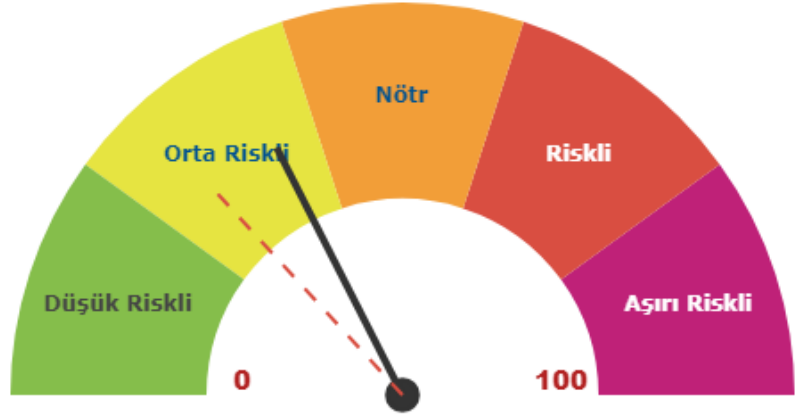
Bu hafta **31** Bir hafta önce **31** Bir ay önce **35**

Gümüş Endeksi
31

GBPUSD

GBPUSD modeli 1 aylık ve 1 haftalık dönemde **orta riskli** bölge içinde yer almaya devam ediyor.

Model bu ay içinde oynak seyrederken bulunduğu konuma dönüş yapmış ve GBPUSD getirisi sabit kalmıştır.



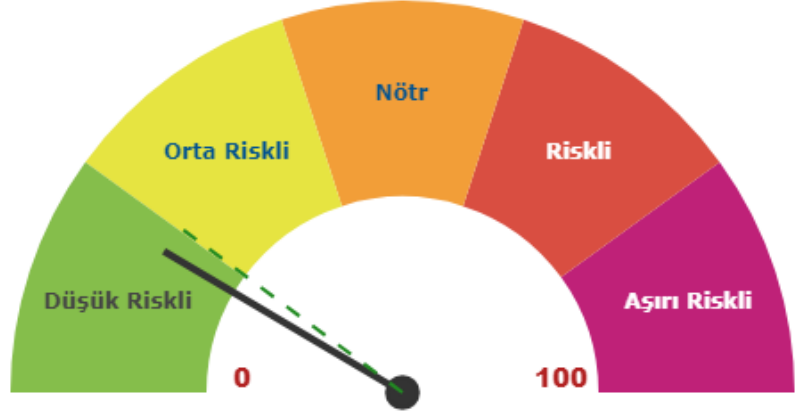
Bu hafta **35** Bir hafta önce **26** Bir ay önce **35**

GBPUSD Endeksi
35

EURUSD

EURUSD modeli geçen hafta geçiş yaptığı **düşük riskli** bölge içinde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

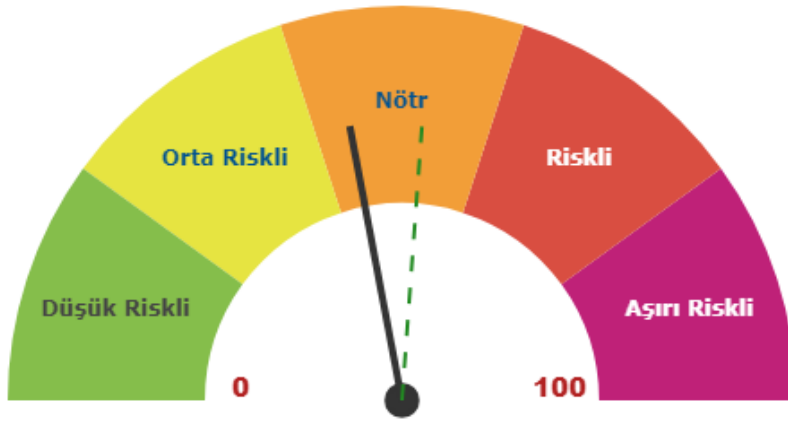
Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada EURUSD paritesi yaklaşık **%0.5**, 1 ayda ise yaklaşık **%1.5 değer kazanmıştır**.



Bu hafta **17** Bir hafta önce **20** Bir ay önce **22**

EURUSD Endeksi
17

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."