

RİSKOMETRE

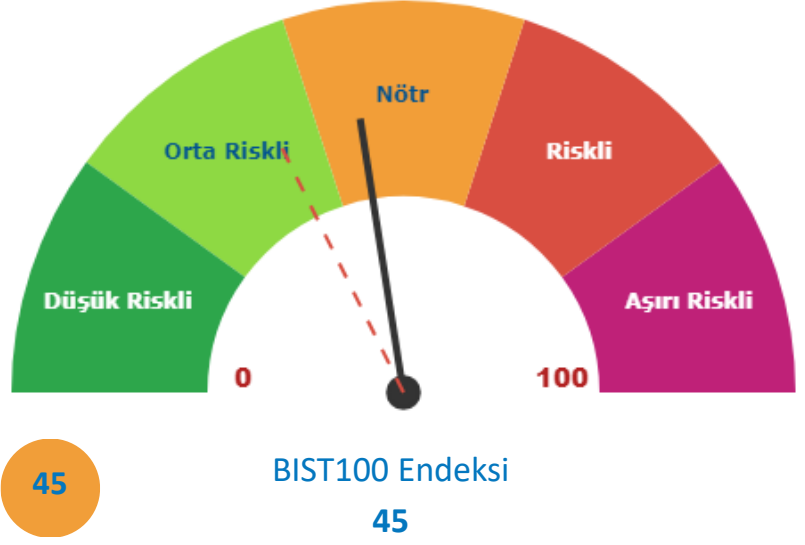
BIST100

11 - 17 Mart 2024

Dalgalı bir dönem geçiren BIST100 modeli, bu hafta orta riskli bölgeden **nötr bölgeye** geçiş yapmıştır.

Model bu hafta riskli yöne ilerleyerek 1 ay önceki konumuna dönüş yaparken, BIST100 Endeksi bu süreçte yaklaşık **%1.5 değer kaybetmiştir**.

Bu hafta **45** Bir hafta önce **35** Bir ay önce **45**

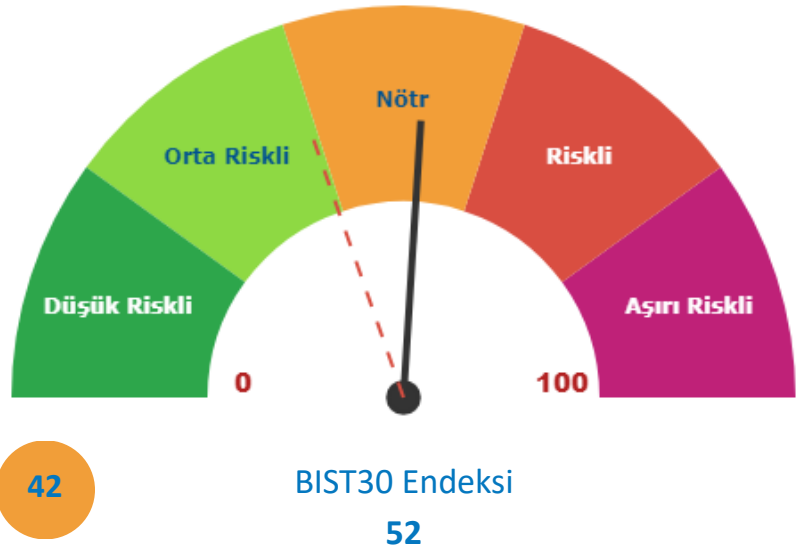


BIST30

BIST30 modeli üç haftadır test ettiği orta riskli bölgeden **nötr bölgeye** geçiş yapmıştır.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftada BIST30 Endeksi yaklaşık **%1.5 değer kaybetmiş**, oynak seyrettiği 1 ayda ise getirisi stabil kalmıştır.

Bu hafta **52** Bir hafta önce **39** Bir ay önce **42**

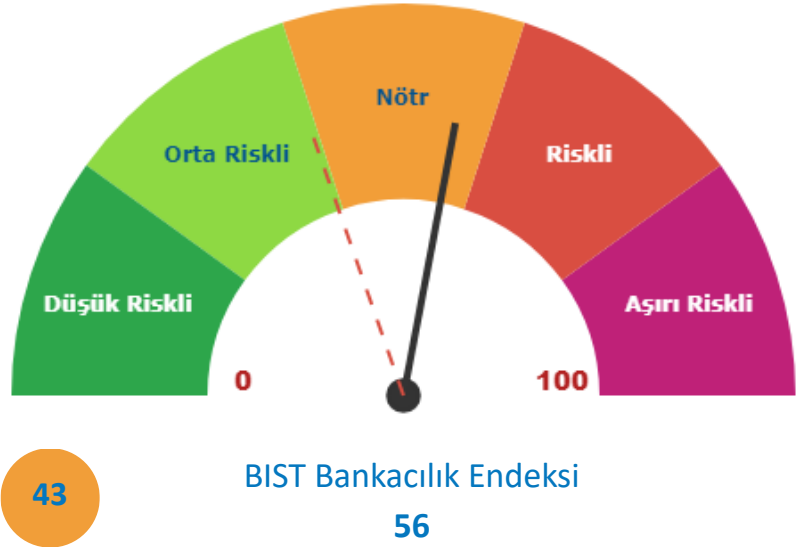


BIST BANKACILIK

BIST Bankacılık Endeksi modeli 1 haftalık ve 1 aylık dönemde riskli yöne ilerleyerek bu hafta **nötr bölgeye** dönüş yapmıştır.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftada yaklaşık **%2 değer kaybeden** BIST Bankacılık endeksi, 1 ay önceye göre yaklaşık **%1 değer kaybetmiştir**.

Bu hafta **56** Bir hafta önce **39** Bir ay önce **43**

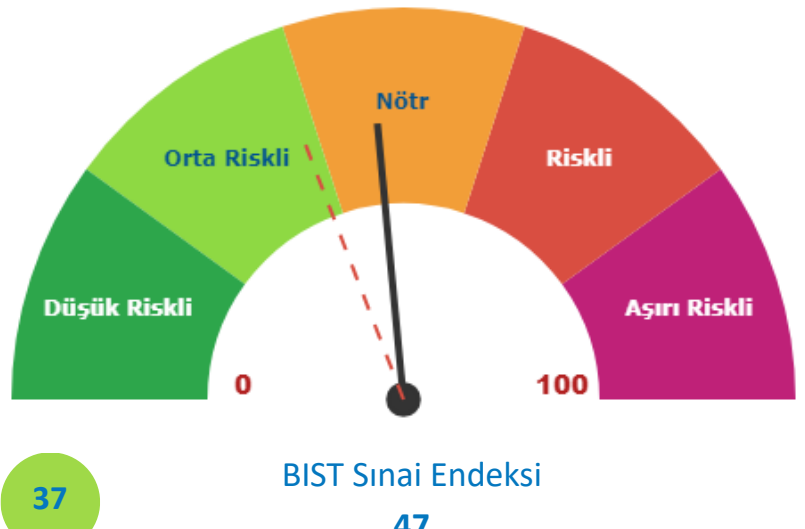


BIST SINAI

BIST Sınai Endeksi modeli bu hafta bulunduğu orta riskli bölgeden **nötr bölgeye** geçiş yapmıştır.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftada BIST Sınai Endeksinin getirisi sabit kalmıştır.

Bu hafta **47** Bir hafta önce **38** Bir ay önce **37**



ALTIN

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

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada Altın fiyatları yaklaşık **%5**, 1 ayda ise yaklaşık **%7 getiri sağlamıştır**.

Bu hafta **32** Bir hafta önce **52** Bir ay önce **45**



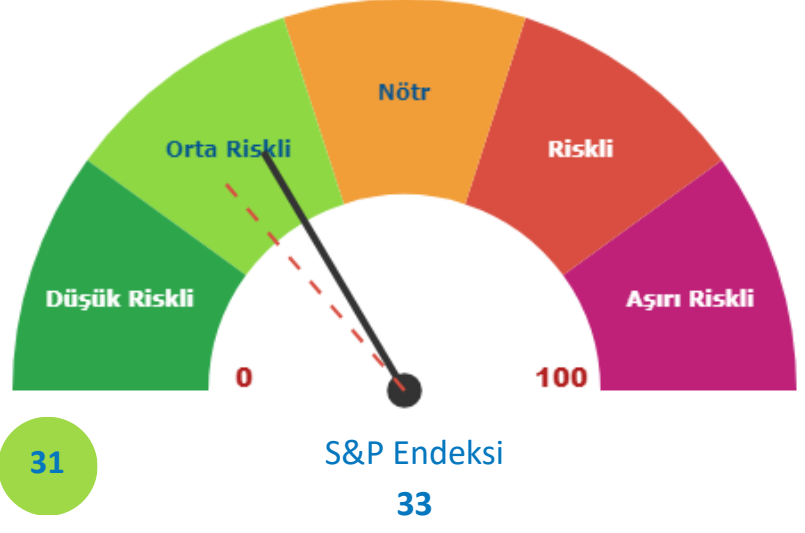
RİSKOMETRE

S&P

11 - 17 Mart 2024

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

Modelin 1 aylık dönemde orta riskli bölgede bulunduğu süre boyunca S&P Endeksi yaklaşık **%3 değer kazanmıştır**.

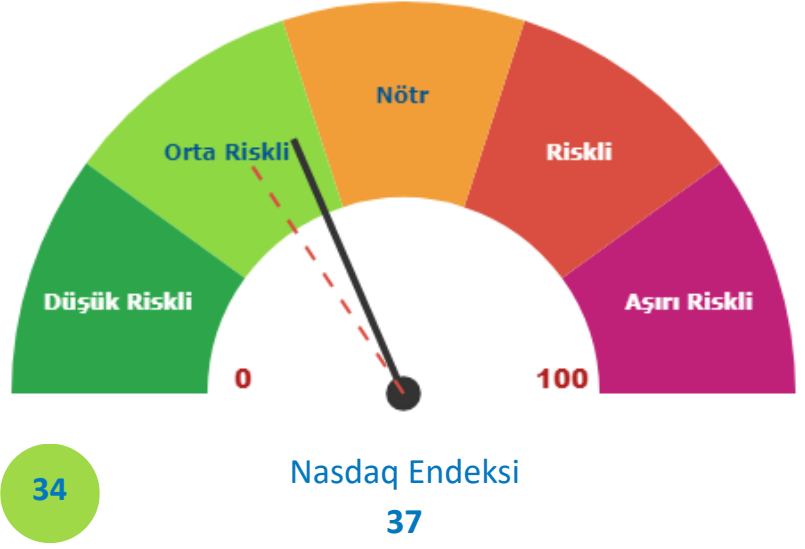


Bu hafta **33** Bir hafta önce **27** Bir ay önce **31**

NASDAQ

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

Model orta risk sinyali verirken 1 haftada getirisi sabit kalan Nasdaq Endeksi 1 aylık dönemde yaklaşık **%2 getiri sağlamıştır**.

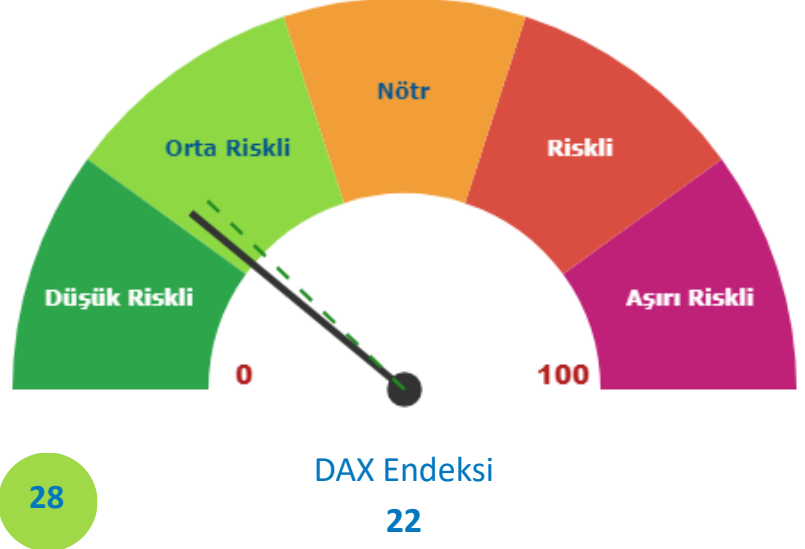


Bu hafta **37** Bir hafta önce **31** Bir ay önce **34**

DAX

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

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada DAX Endeksi yaklaşık **%1**, 1 ayda ise **%5.5 değer kazanmıştır**.

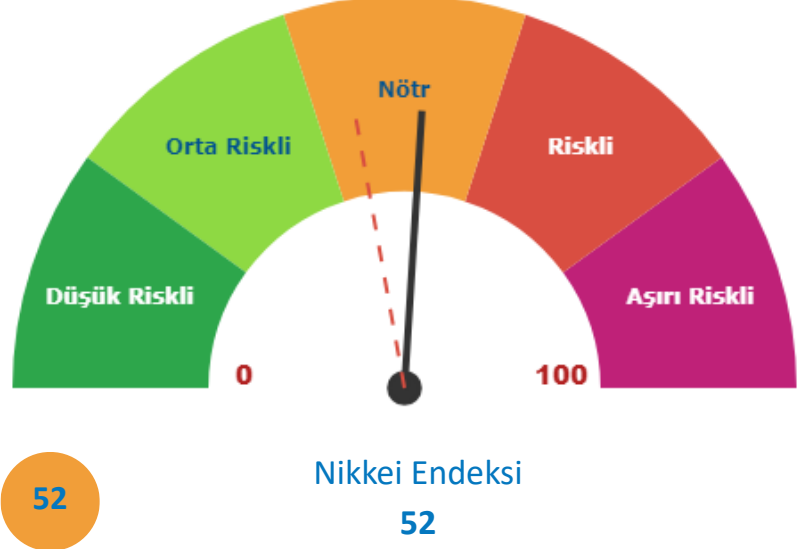


Bu hafta **22** Bir hafta önce **24** Bir ay önce **28**

NIKKEI

Japonya Hisse Senedi modeli bu hafta **nötr bölge** içinde riskli yöne ilerleyerek 1 ay önceki konumuna dönüş yapmıştır.

Model nötr sinyal vermeye devam ederken Nikkei Endeksi 1 ayda yaklaşık **%7.5 getiri sağlamıştır**.

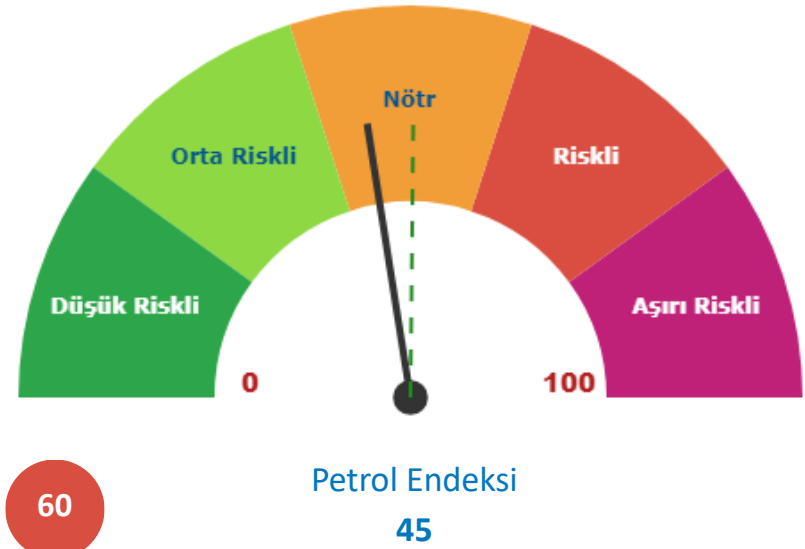


Bu hafta **52** Bir hafta önce **44** Bir ay önce **52**

PETROL

Petrol modeli bu hafta **nötr bölge** içinde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada sabit seyreden Petrol fiyatları 1 aylık dönemde yaklaşık **%2 değer kazanmıştır**.



Bu hafta **45** Bir hafta önce **50** Bir ay önce **60**

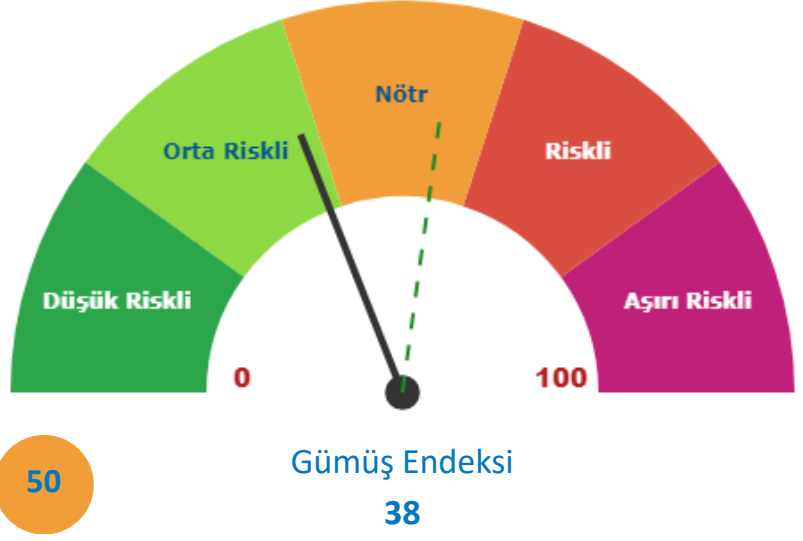
RİSKOMETRE

GÜMÜŞ

11 - 17 Mart 2024

Gümüş modeli bu hafta, 1 aydır bulunduğu nötr bölgeden **orta riskli bölgeye** geçiş yapmıştır.

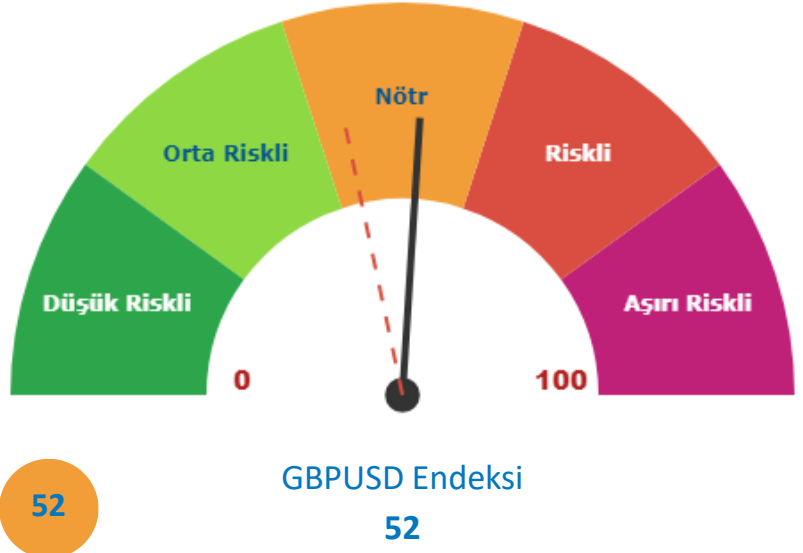
Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada Gümüş fiyatları yaklaşık **%4**, 1 ayda ise yaklaşık **%8 değer kazanmıştır**.



GBPUSD

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

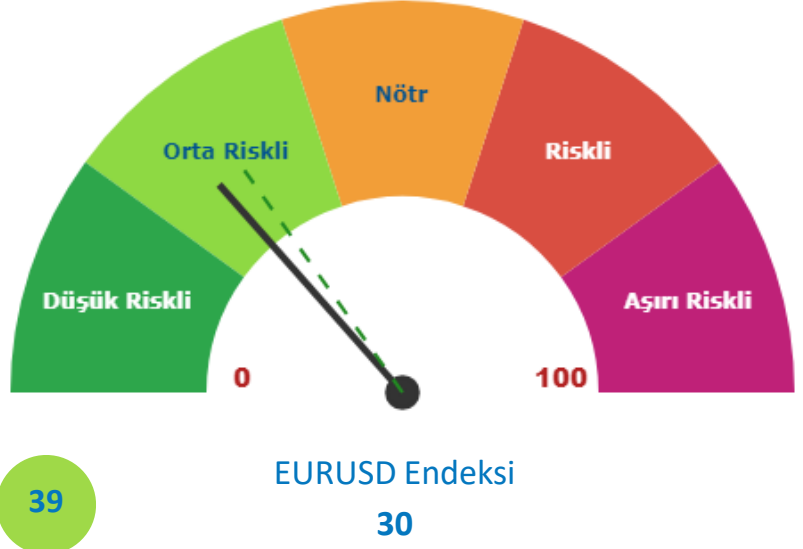
Modelin görece dalgalı seyrettiği 1 ayda GBPUSD paritesi yaklaşık **%2.5 değer kazanmıştır**.



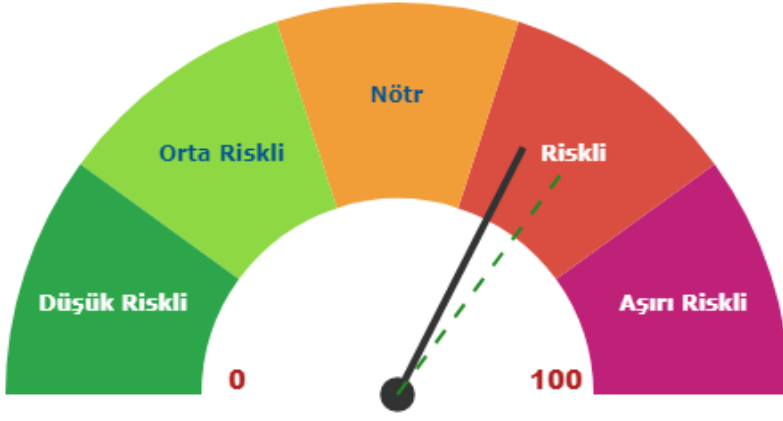
EURUSD

EURUSD modeli bu hafta **orta riskli bölge** içinde konumunu korumuştur.

Modelin orta risk sinyalini sürdürdüğü 1 haftada EURUSD paritesi yaklaşık **%1**, düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda ise **%1.6 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."