

RİSKOMETRE

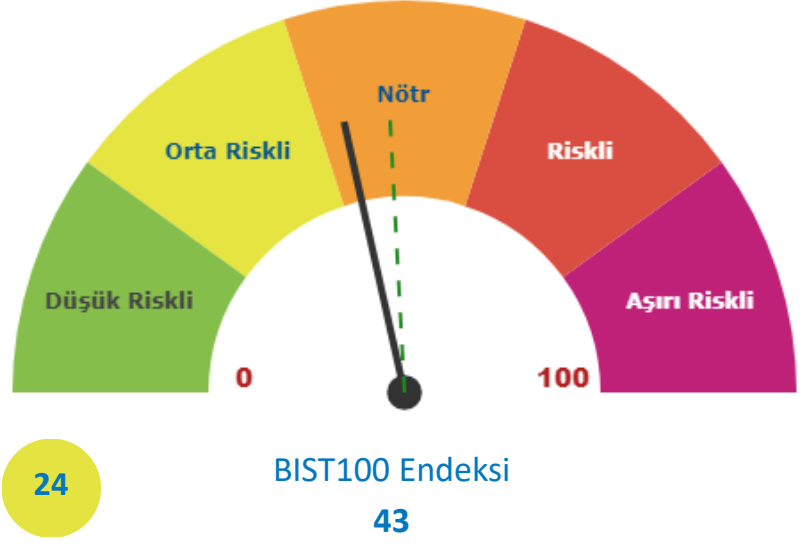
BIST100

15 - 21 Ocak 2024

BIST100 modeli geçen hafta geçiş yaptığı **nötr** bölge içinde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada BIST100 Endeksi yaklaşık **%3.5 değer kazanmış**, riskli yöne ilerlediği 1 ayda ise yaklaşık **%2 değer kaybetmiştir**.

Bu hafta **43** Bir hafta önce **48** Bir ay önce **24**



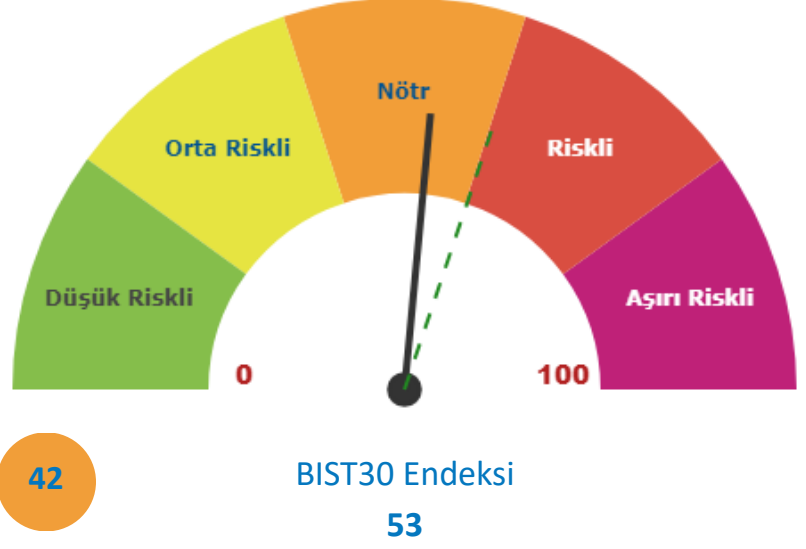
BIST100 Endeksi
43

BIST30

BIST30 modeli geçtiğimiz hafta **nötr** bölge içinde riskli bölge sınırını test ederken, bu hafta yönünü düşük riskli yöne çevirmiştir.

Modelin düşük riskli yönde ilerlediği 1 haftalık dönemde BIST30 Endeksinde yaklaşık **%4.5 getiri** gözlenmiştir.

Bu hafta **53** Bir hafta önce **60** Bir ay önce **42**



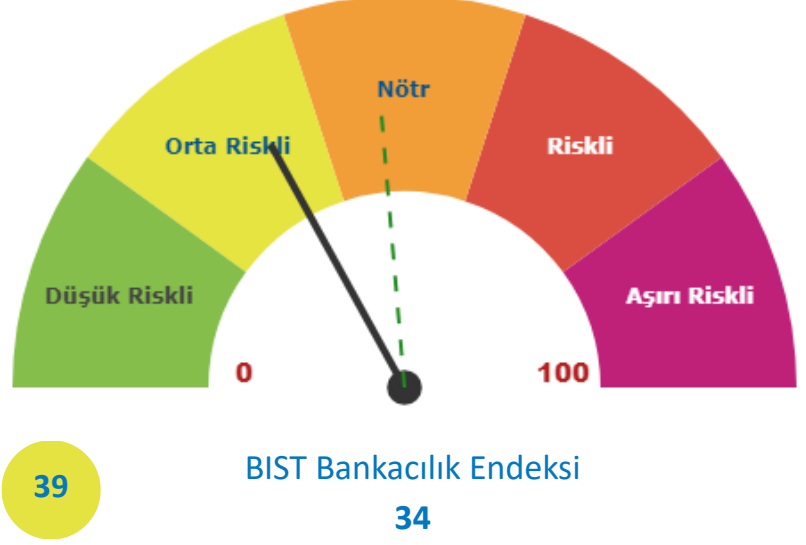
BIST30 Endeksi
53

BIST BANKACILIK

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

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftalık dönemde BIST Bankacılık Endeksi yaklaşık **%10.5**, 1 aylık dönemde ise yaklaşık **%5 getiri** sağlamıştır.

Bu hafta **34** Bir hafta önce **47** Bir ay önce **39**



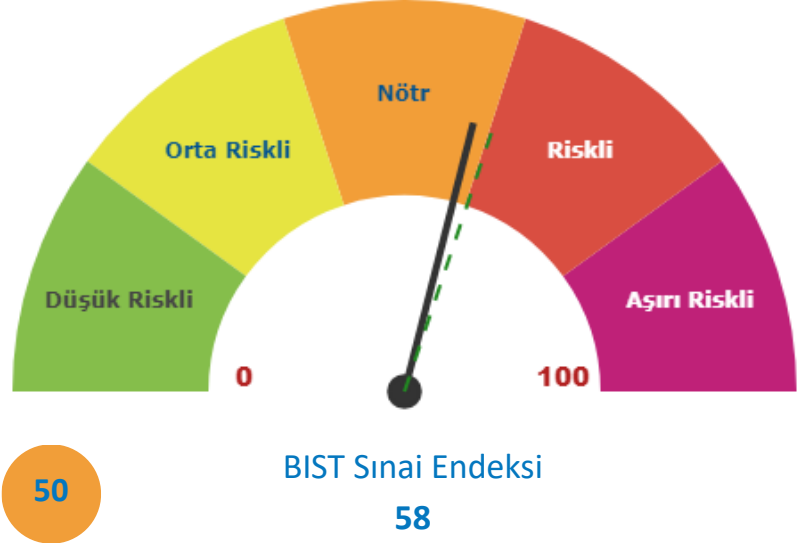
BIST Bankacılık Endeksi
34

BIST SINAI

BIST Sınai Endeksi modeli 1 haftalık ve 1 aylık dönemde **nötr** bölge içinde kalmaya devam etmektedir.

Modelin 1 aylık riskli yönde hareketi ile aynı dönemde BIST Sınai Endeksinde yaklaşık **%6 değer kaybı** gözlenmiştir.

Bu hafta **58** Bir hafta önce **60** Bir ay önce **50**



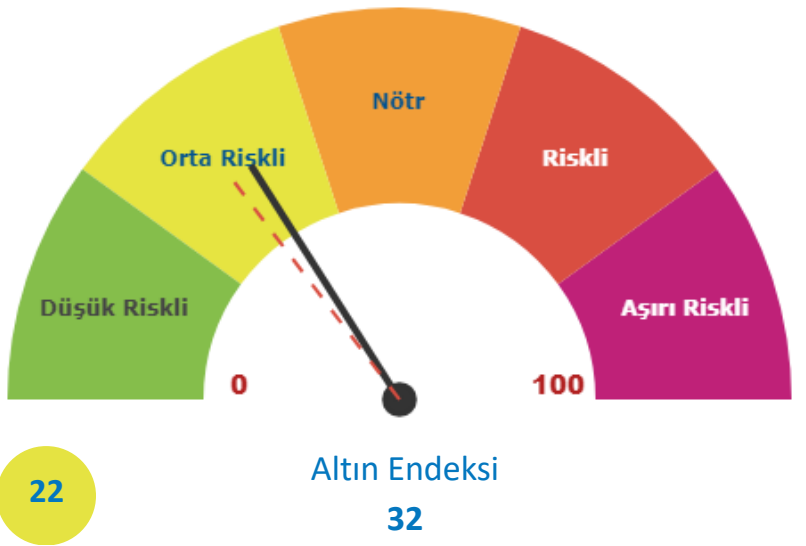
BIST Sınai Endeksi
58

ALTIN

Altın modeli 1 aydır bulunduğu **orta riskli** bölge içinde riskli yöne ilerlemeye devam etmektedir.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftalık dönemde Altın fiyatları yatay seyrederken, 1 aylık dönemde yaklaşık **%1 değer kaybetmiştir**.

Bu hafta **32** Bir hafta önce **29** Bir ay önce **22**



Altın Endeksi
32

RİSKOMETRE

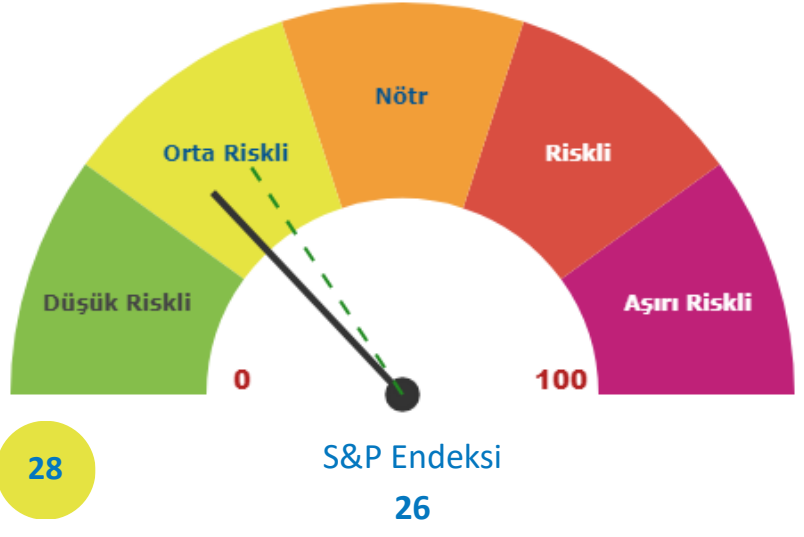
S&P

15 - 21 Ocak 2024

ABD Hisse Senedi modeli 1 haftalık ve 1 aylık dönemde **orta riskli** bölge içinde konumunu korumaktadır.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada S&P Endeksi yaklaşık **%2**, 1 ayda ise yaklaşık **%1.5** değer kazanmıştır.

Bu hafta **26** Bir hafta önce **31** Bir ay önce **28**

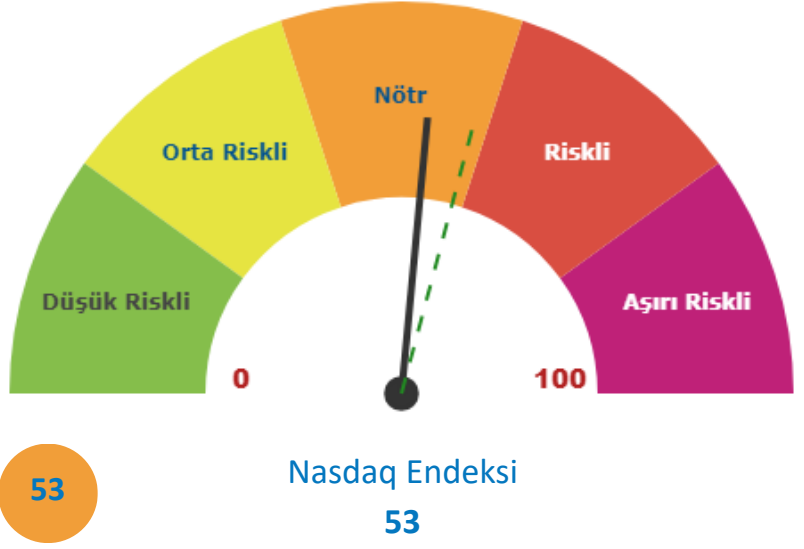


NASDAQ

NASDAQ modeli 1 aydır **nötr** bölge içinde yer almaya devam etmektedir.

Model bu hafta düşük riskli yöne ilerlerken 1 ay önceki konumuna dönüş yapmış, 1 haftada NASDAQ Endeksinde yaklaşık **%3.5** getiri gözlenmiştir.

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

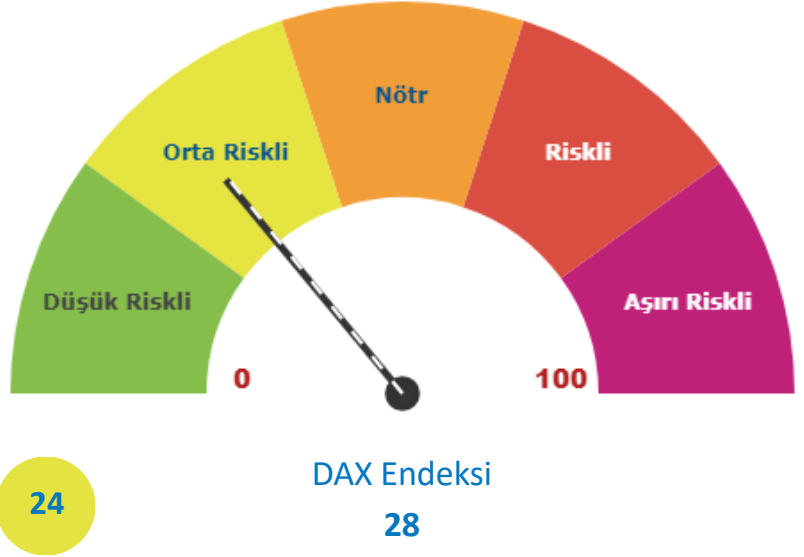


DAX

Almanya Hisse Senedi modeli bu hafta bulunduğu **orta riskli** bölge içinde konumunu korumaktadır.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 aylık dönemde DAX Endeksi yaklaşık **%1.5** değer kaybı yaşamıştır.

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

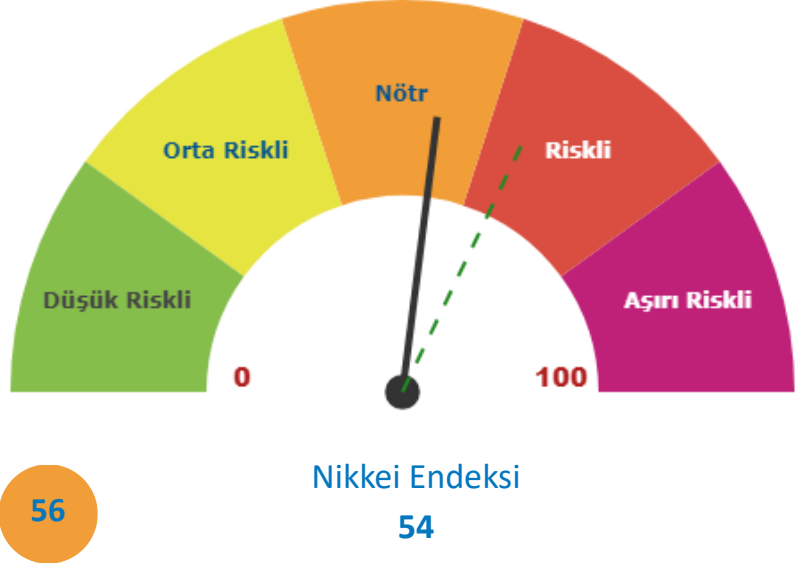


NIKKEI

Japonya Hisse Senedi modeli bu hafta riskli bölgeden **nötr** bölgeye geçiş yapmıştır.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftalık dönemde Nikkei Endeksi yaklaşık **%6**, oynak seyrettiği 1 aylık dönemde ise yaklaşık **%8** getiri sağlamıştır.

Bu hafta **54** Bir hafta önce **64** Bir ay önce **56**

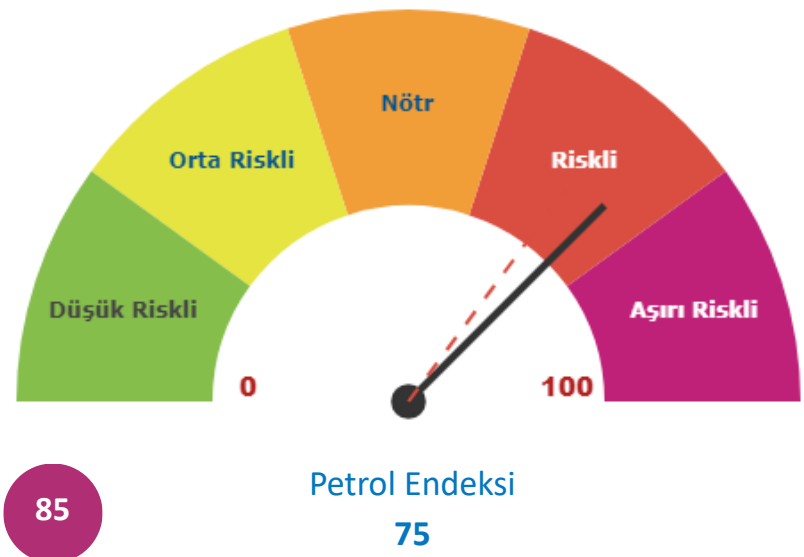


PETROL

Petrol modeli bu hafta **riskli** bölge içinde konumunu korumaktadır.

Petrol fiyatları modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 aylık dönemde yaklaşık **%3.5** değer kazanmıştır.

Bu hafta **70** Bir hafta önce **70** Bir ay önce **85**



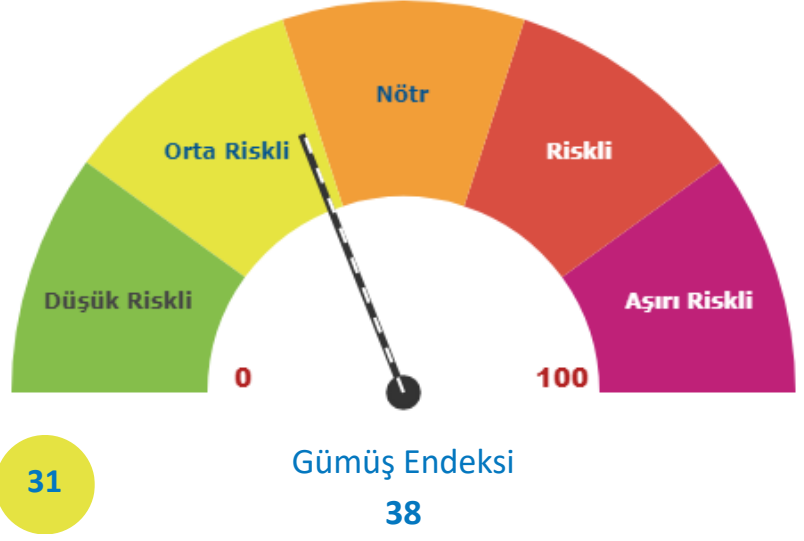
RİSKOMETRE

GÜMÜŞ

15 - 21 Ocak 2024

Gümüş modeli bu hafta **orta riskli** bölge içinde konumunu korumaktadır.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 aylık dönemde Gümüş fiyatlarında yaklaşık **%4.5 değer kaybı** gözlenmiştir.

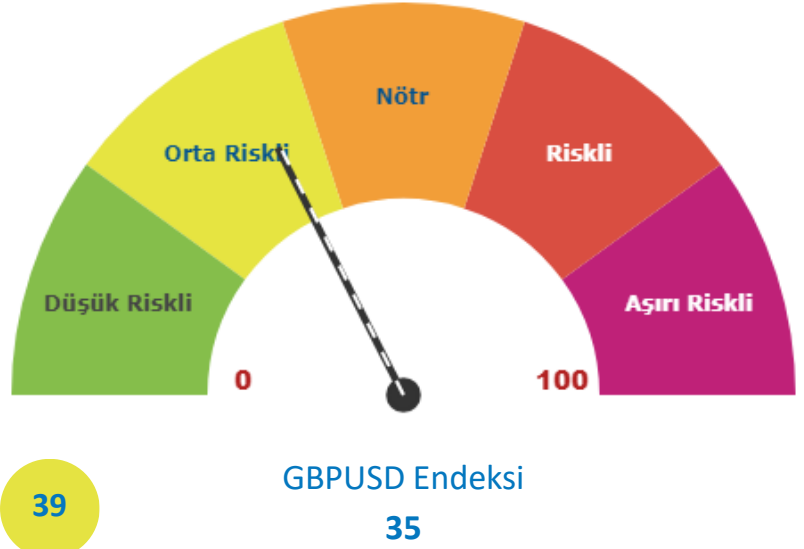


Bu hafta **38** Bir hafta önce **38** Bir ay önce **31**

GBPUSD

GBPUSD modeli 1 aylık ve 1 haftalık dönemde **orta riskli** bölge içinde bulunmaktadır.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 aylık dönemde GBPUSD paritesi yaklaşık **%1 değer kazanmıştır**.

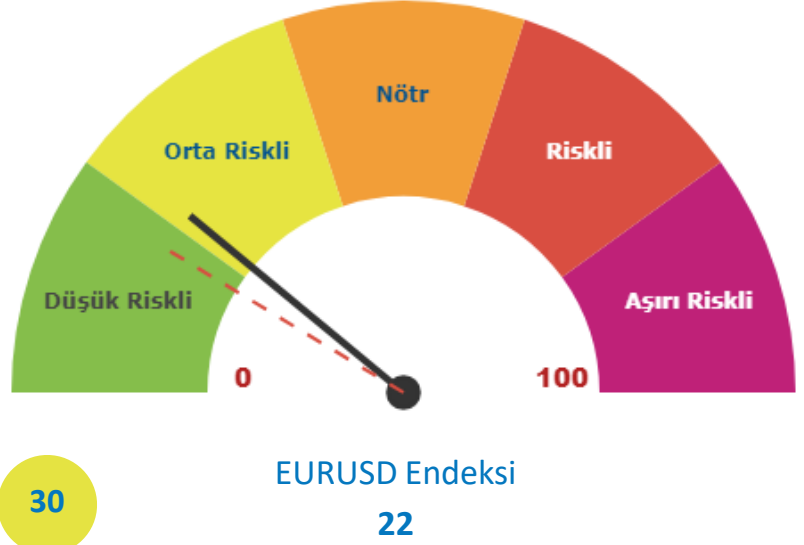


Bu hafta **35** Bir hafta önce **35** Bir ay önce **39**

EURUSD

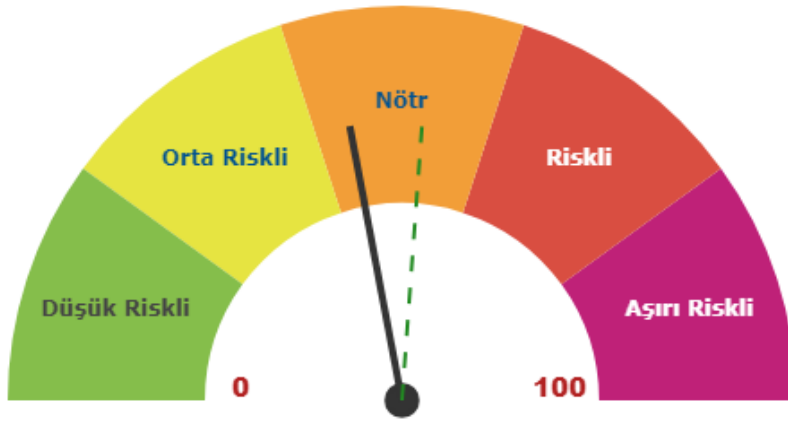
EURUSD modeli bu hafta düşük riskli bölgeden **orta riskli** bölgeye geçiş yapmıştır.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 aylık dönemde EURUSD paritesi yaklaşık **%1 değer kazanmıştır**.



Bu hafta **22** Bir hafta önce **17** Bir ay önce **30**

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."