

RİSKOMETRE

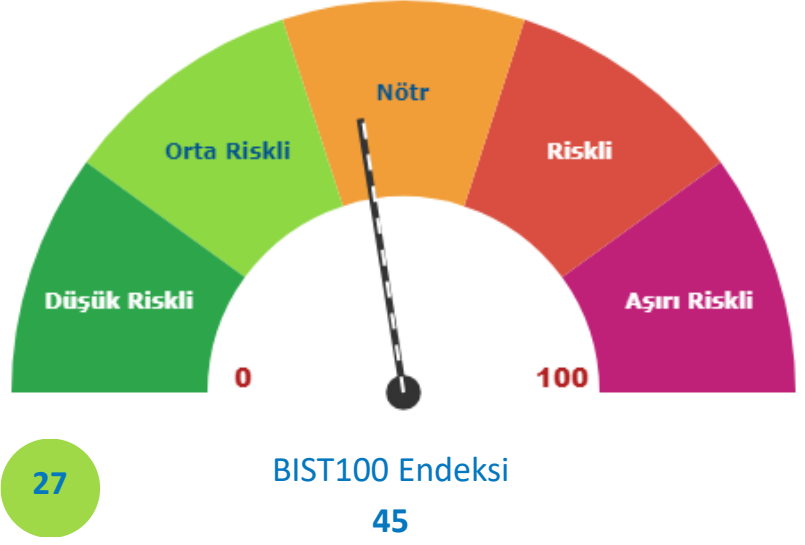
BIST100

18 - 24 Mart 2024

Bu hafta **nötr bölgede** sabit seyreden BIST100 modeli 1 aylık dönemde riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin nötr sinyal verdiği 1 haftalık dönemde yaklaşık **%3 değer kaybeden** BIST100 endeksi, modelin riskli yöne ilerlediği 1 ayda yaklaşık **%4 değer kaybetmiştir.**

Bu hafta **45** Bir hafta önce **45** Bir ay önce **27**

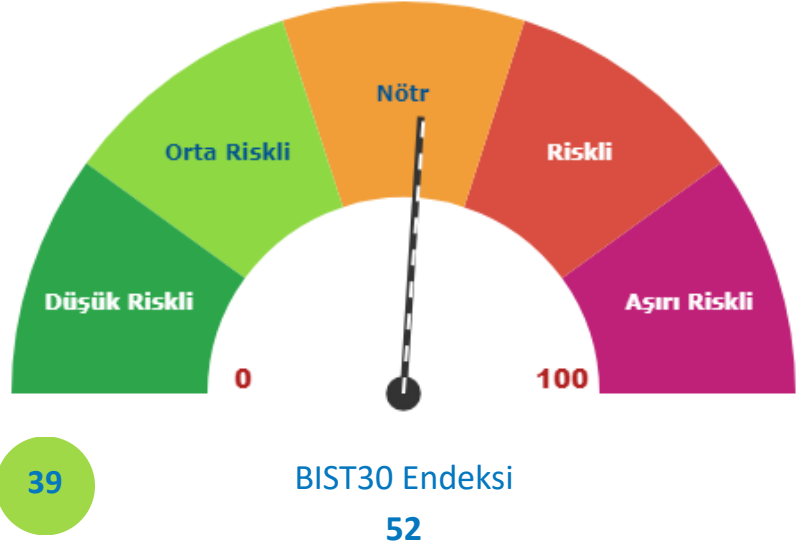


BIST30

BIST30 modeli geçen hafta geçiş yaptığı **nötr bölgede** konumunu koruyarak son 1 yılda bu bölgede geçirdiği ortalama 1 aylık sürenin yarısını tamamlamıştır.

Modelin sabit seyrettiği 1 haftada BIST30 Endeksi yaklaşık **%2.5**, riskli yöne ilerlediği 1 ayda ise yaklaşık **%4 değer kaybı** yaşamıştır.

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

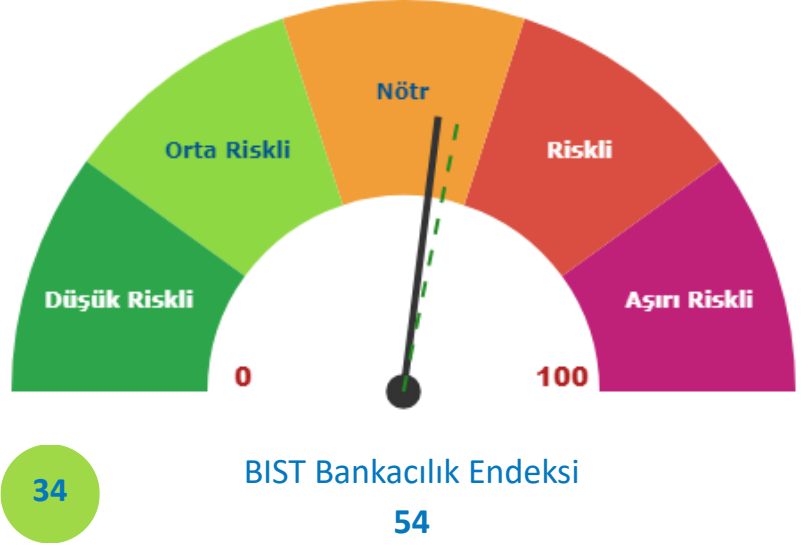


BIST BANKACILIK

BIST Bankacılık Endeksi modeli bu hafta **nötr bölge** içinde düşük riskli yöne ilerlerken son 1 yılda bölgede geçirdiği ortalama 2 haftalık zaman dilimine oldukça yaklaşmış durumdadır.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 ayda BIST Bankacılık Endeksi yaklaşık **%6 değer kaybı** yaşamıştır.

Bu hafta **54** Bir hafta önce **56** Bir ay önce **34**

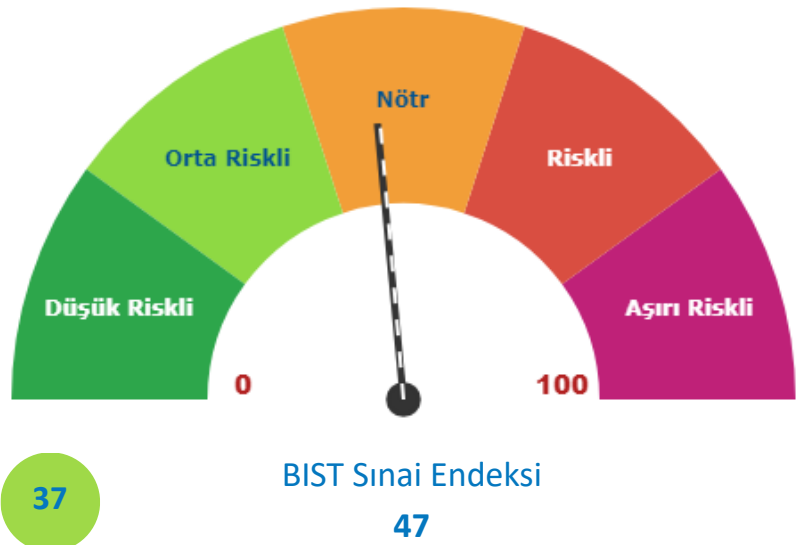


BIST SINAI

1 aylık dönemde riskli yöne ilerleyen BIST Sınai Endeksi modeli bu hafta bulunduğu **nötr bölgede** sabit seyretmiştir.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 aylık dönemde BIST Sınai Endeksi yaklaşık **%3.5 değer kaybetmiştir.**

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

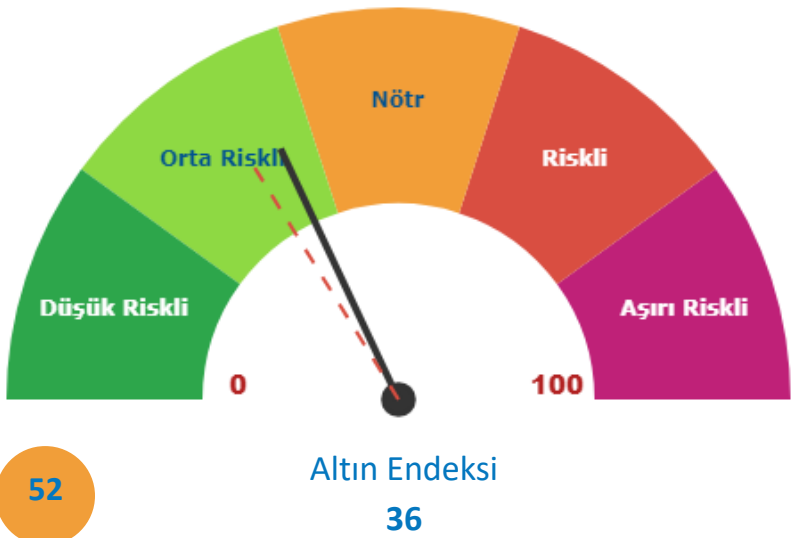


ALTIN

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

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftada Altın fiyatları yaklaşık **%0.5 değer kaybetmiş**, düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda ise yaklaşık **%8 değer kazanmıştır.**

Bu hafta **36** Bir hafta önce **32** Bir ay önce **52**



RİSKOMETRE

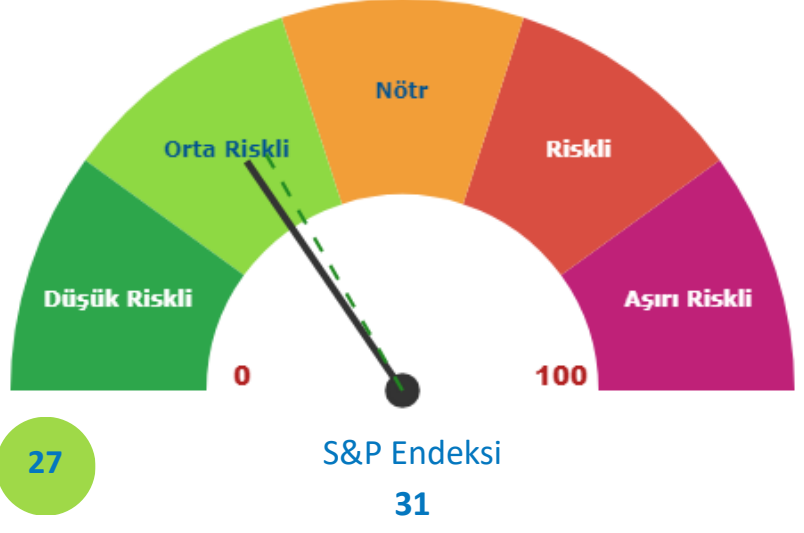
S&P

18 - 24 Mart 2024

ABD Hisse Senedi modeli 1 haftalık ve 1 aylık dönemde **orta riskli bölge** içinde bulunmaya devam etmektedir.

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

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

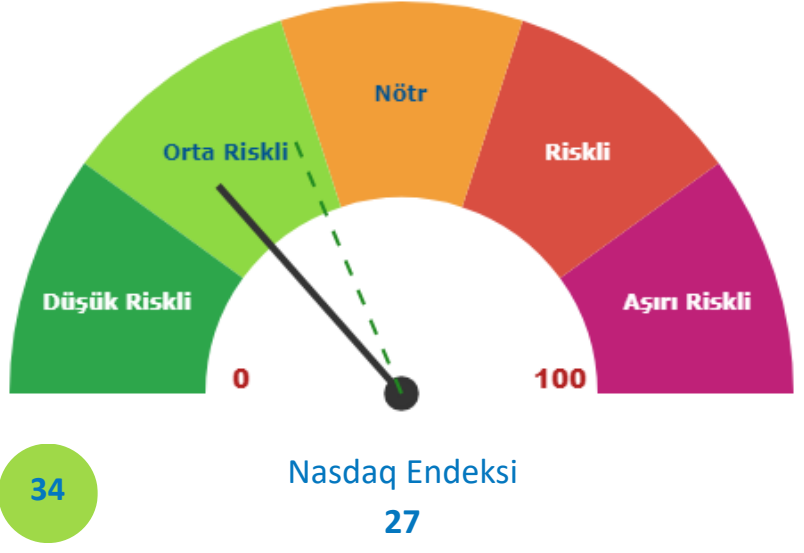


NASDAQ

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

Model düşük riskli yöne ilerlerken Nasdaq Endeksi 1 aylık dönemde yaklaşık **%2 getiri sağlamıştır**.

Bu hafta **27** Bir hafta önce **37** Bir ay önce **34**

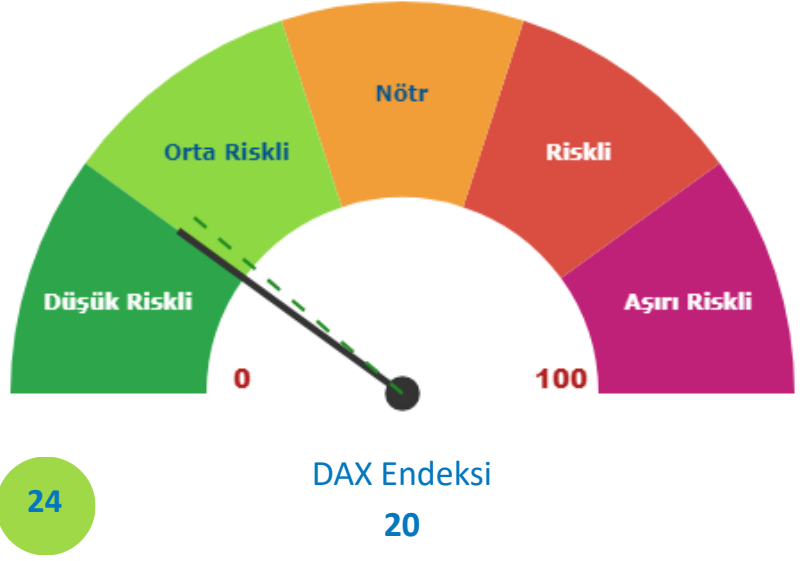


DAX

Almanya Hisse Senedi modeli 1 haftalık ve 1 aylık dönemde düşük riskli yöne ilerleyerek bu hafta **düşük riskli bölge** sınırına geçiş yapmıştır.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda DAX Endeksi yaklaşık **%5 değer kazanmıştır**.

Bu hafta **20** Bir hafta önce **22** Bir ay önce **24**



NIKKEI

Japonya Hisse Senedi modeli 1 haftalık ve 1 aylık dönemde **nötr bölge** içinde riskli yöne ilerleyişini sürdürmüştür.

Model nötr sinyal vermeye devam ederken Nikkei Endeksi 1 haftada yaklaşık **%2.5 değer kaybı yaşamıştır**.

Bu hafta **56** Bir hafta önce **52** Bir ay önce **44**

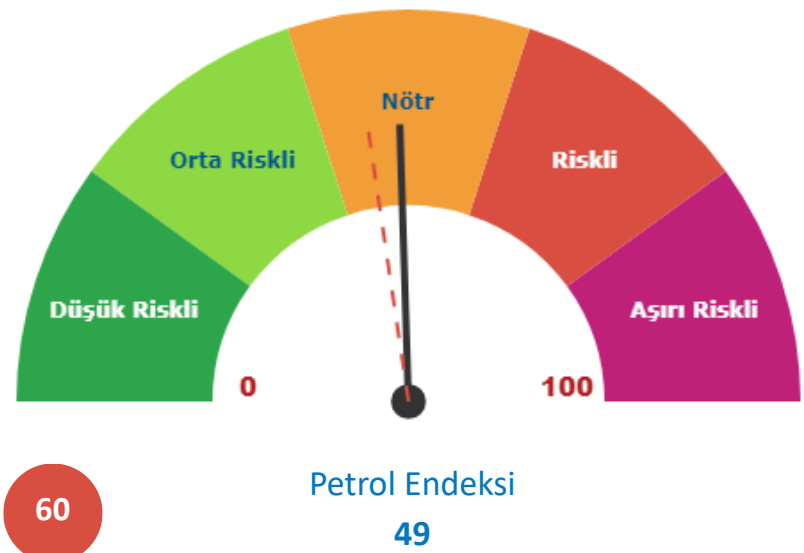


PETROL

Petrol modeli bu hafta **nötr bölge** içinde riskli yöne ilerlerken son 1 yılda bu bölgede geçirdiği ortalama süreye ulaşmıştır.

Modelin nötr sinyal verdiği 1 haftada **%4 değer kazanan** Petrol fiyatları modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 aylık dönemde yaklaşık **%2 değer kazanmıştır**.

Bu hafta **49** Bir hafta önce **45** Bir ay önce **60**



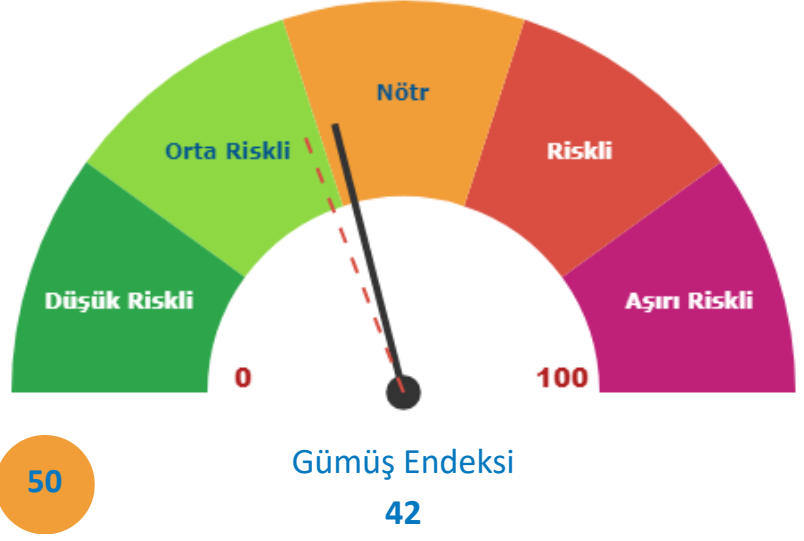
RİSKOMETRE

GÜMÜŞ

18 - 24 Mart 2024

Geçtiğimiz hafta orta riskli bölgeyi test eden Gümüş modeli bu hafta **nötr bölgeye** dönüş yapmıştır.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda Gümüş fiyatları yaklaşık **%7.5 değer kazanmıştır**.

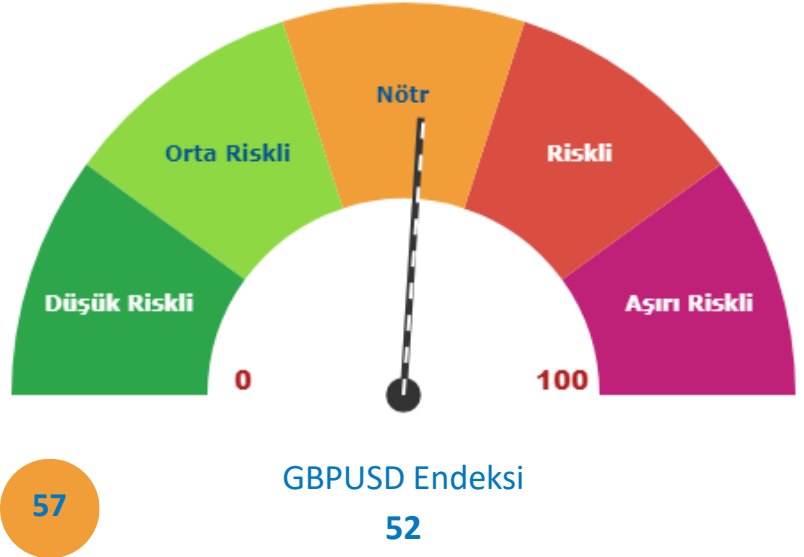


Bu hafta **42** Bir hafta önce **38** Bir ay önce **50**

GBPUSD

GBPUSD modeli bu hafta bulunduğu **nötr bölge** içinde sabit seyretmiştir.

Modelin nötr sinyal verdiği 1 haftada yaklaşık **%1 değer kaybeden** GBPUSD paritesi 1 ayda yaklaşık **%1 değer kazanmıştır**.

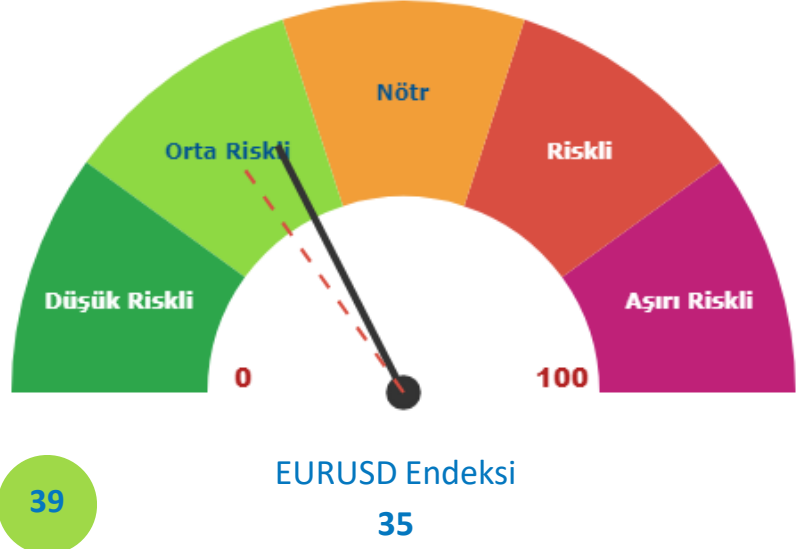


Bu hafta **52** Bir hafta önce **52** Bir ay önce **57**

EURUSD

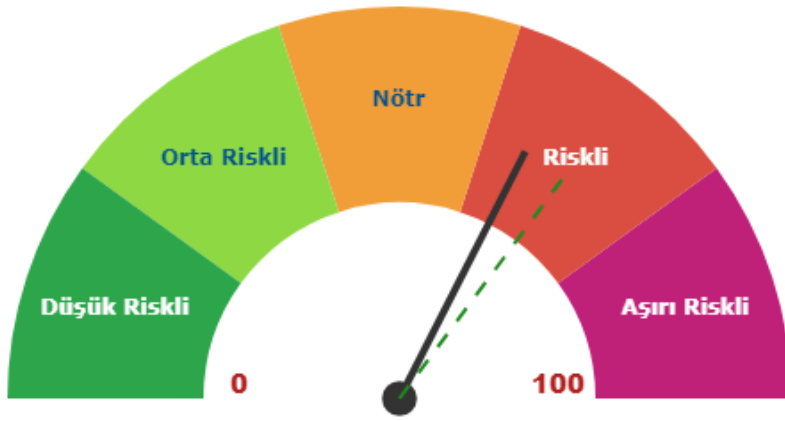
EURUSD modeli bu hafta **orta riskli bölge** içinde riskli yöne ilerlemiştir.

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



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

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."