

RİSKOMETRE

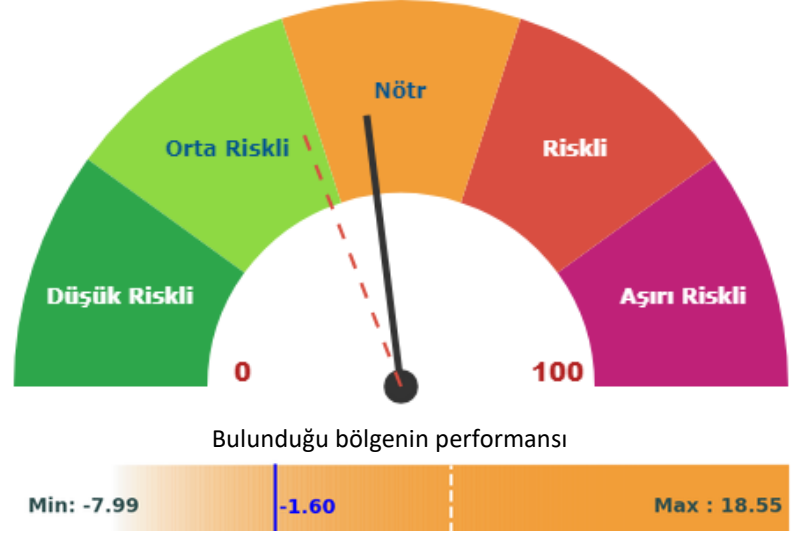
BIST100

22 - 28 Nisan 2024

1 haftalık ve 1 aylık dönemde riskli yöne ilerleyen BIST100 modeli hafta başında **nötr bölgeye** geçiş yapmıştır.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftada BIST100 endeksi yaklaşık %3 değer kaybederken, model nötr bölgeye girdiğinden beri **endeks getirisi bu bölgedeki ortalamasının altında kalmıştır.**

Bu hafta **46** Bir hafta önce **38** Bir ay önce **35**

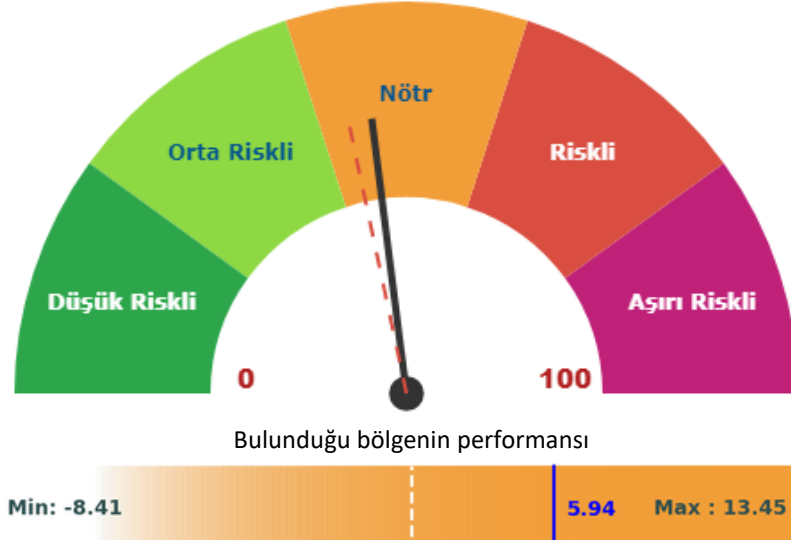


BIST30

BIST30 modeli bu hafta 1 aydır bulunduğu **nötr bölge** içinde riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftada BIST30 Endeksi yaklaşık %3 değer kaybetmiş, düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda ise yaklaşık %5 değer kazanmıştır. Nötr bölgede bulunduğu dönem boyunca **endeks getirisi tarihsel ortalamasının üzerine ulaşmıştır.**

Bu hafta **46** Bir hafta önce **43** Bir ay önce **57**

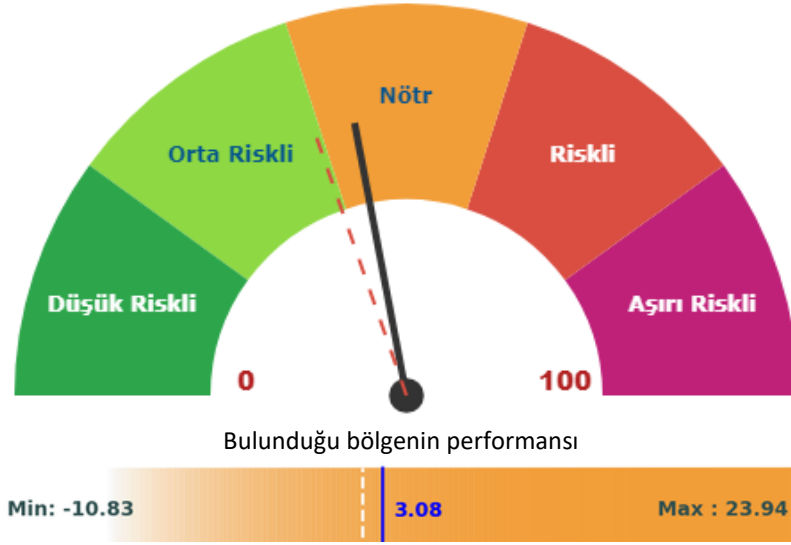


BIST BANKACILIK

BIST Bankacılık Endeksi bu hafta riskli yöne ilerleyerek **nötr bölgeye** geçiş yapmıştır.

Modelin **riskli** yöne doğru ilerlediği 1 haftada BIST Bankacılık Endeksi yaklaşık %2.2 değer kaybı yaşamıştır. Model nötr bölgeye girdiğinden beri **endeks performansı ortalamasının üzerinde seyretmektedir.**

Bu hafta **46** Bir hafta önce **39** Bir ay önce **54**

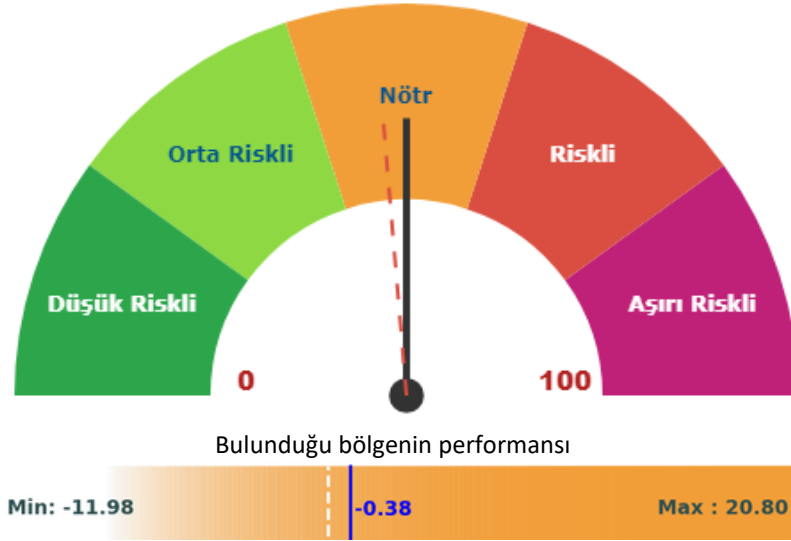


BIST SINAI

BIST Sınai modeli bu hafta **nötr bölge** içinde riskli yöne ilerleyerek 1 ay önceki konumuna dönüş yapmıştır.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftada BIST Sınai Endeksi yaklaşık %2.5 değer kaybederken bölgeye girdiğinden beri getirisi nötr bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde seyretmektedir.**

Bu hafta **50** Bir hafta önce **47** Bir ay önce **50**

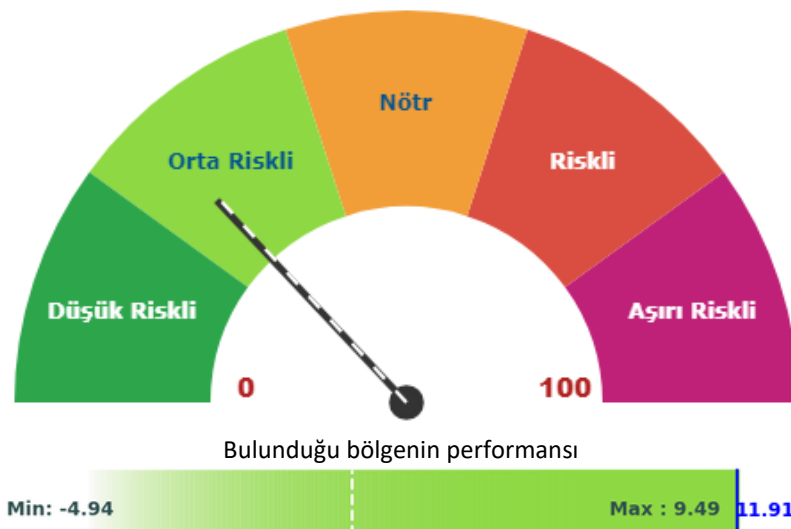


ALTIN

Altın modeli 1 aylık dönemde düşük riskli yöne ilerlerken **orta risk** sinyali vermeye devam etmektedir.

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

Bu hafta **26** Bir hafta önce **26** Bir ay önce **36**



RİSKOMETRE

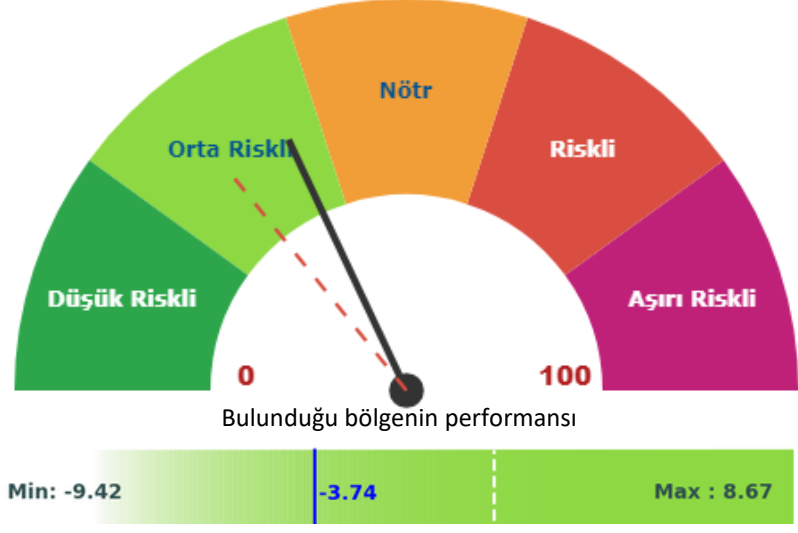
S&P

22 - 28 Nisan 2024

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

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 ayda S&P Endeksi yaklaşık **%4.5 değer kaybetmiş** ve getirisi orta riskli bölgeye girdiğinden beri **bu bölgedeki tarihsel performansının altında bulunmaktadır.**

Bu hafta **36** Bir hafta önce **28** Bir ay önce **27**

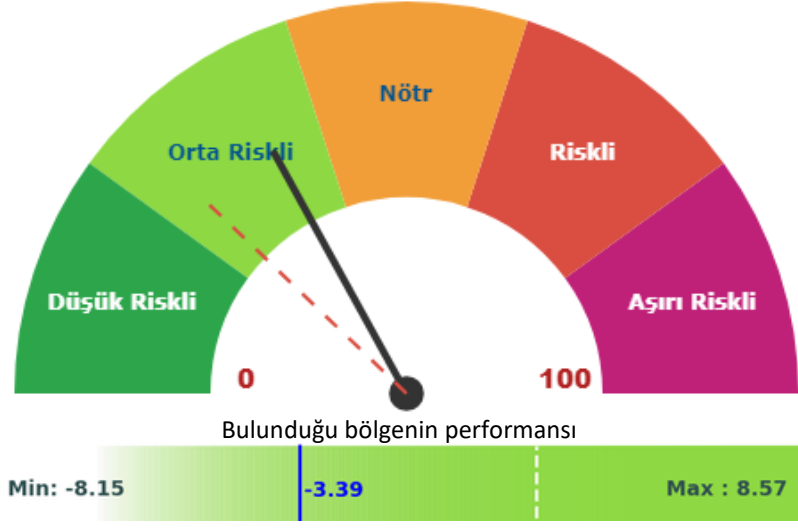


NASDAQ

Ay ortasında düşük riskli bölgeyi test eden NASDAQ modeli **orta riskli bölgeye** dönüş yapmış ve bu hafta riskli yöne ilerlemiştir.

NASDAQ Endeksi, modelin riskli yöne ilerlediği 1 aylık dönemde yaklaşık **%5 değer kaybetmiştir.**

Bu hafta **34** Bir hafta önce **24** Bir ay önce **24**

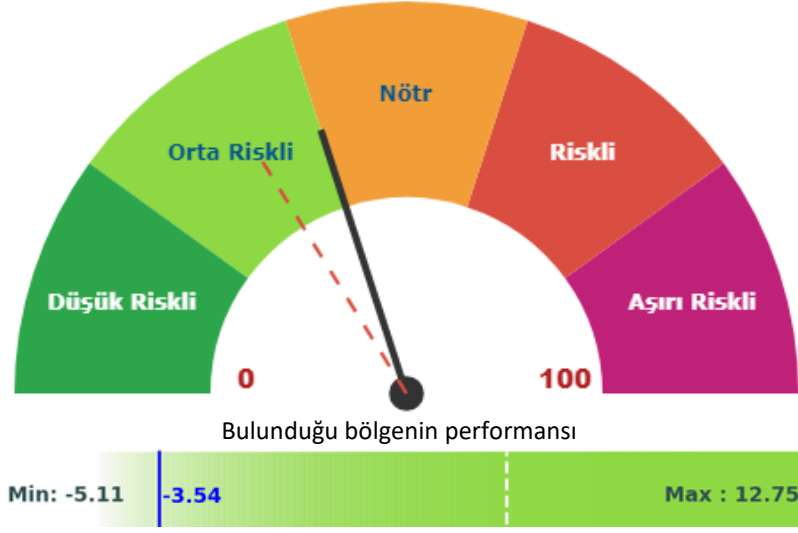


DAX

Almanya Hisse Senedi modeli 3 haftadır **orta riskli bölge** içinde yer alırken riskli yöne hareketini sürdürmektedir.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 ayda DAX Endeksi yaklaşık **%2 değer kaybetmiş** ve düşük riskli bölgeye girdiğinden beri **getirisi bölge ortalamasının altında kalmıştır.**

Bu hafta **40** Bir hafta önce **32** Bir ay önce **20**

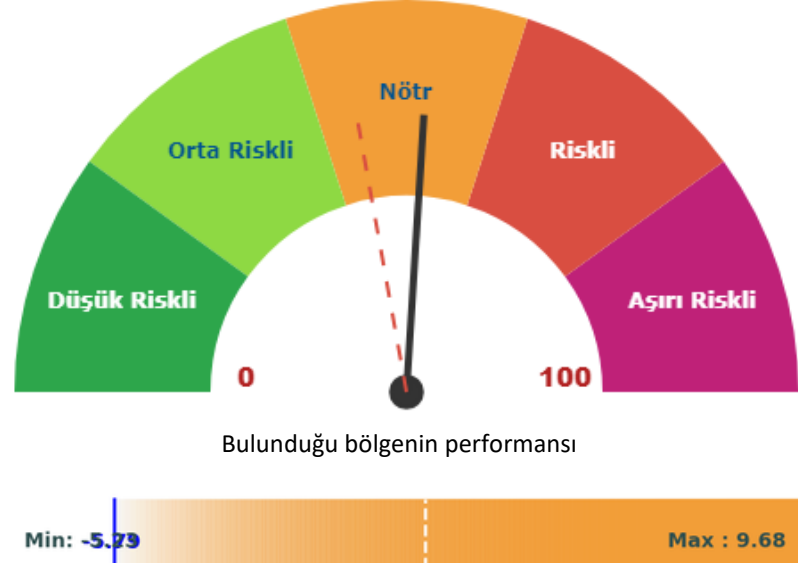


NIKKEI

10 gün önce orta riskli bölgeyi test eden Japonya Hisse Senedi modeli riskli yöne ilerleyerek **nötr bölgeye** dönüş yapmıştır.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 ayda yaklaşık **%9.5 değer kaybeden** Nikkei Endeksi, nötr bölgedeki tarihsel performansının **en düşük getiri seviyesinde bulunmaktadır.**

Bu hafta **52** Bir hafta önce **48** Bir ay önce **44**

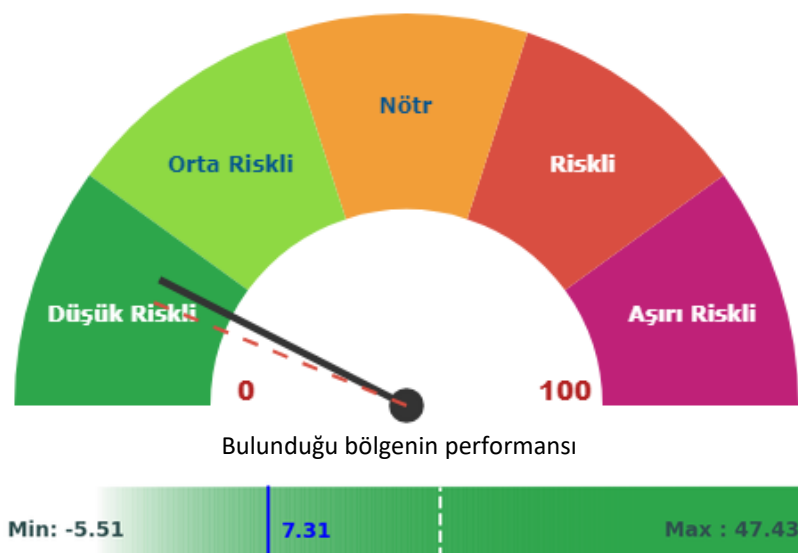


PETROL

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

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftada Petrol fiyatları yaklaşık **%2.5 değer kaybetmiştir.** Model yaklaşık 1 aydır düşük riskli bölgede yer alırken bölgeye girdiğinden beri getirisi **tarihsel ortalamasının altında bulunmaktadır.**

Bu hafta **15** Bir hafta önce **12** Bir ay önce **20**



RİSKOMETRE

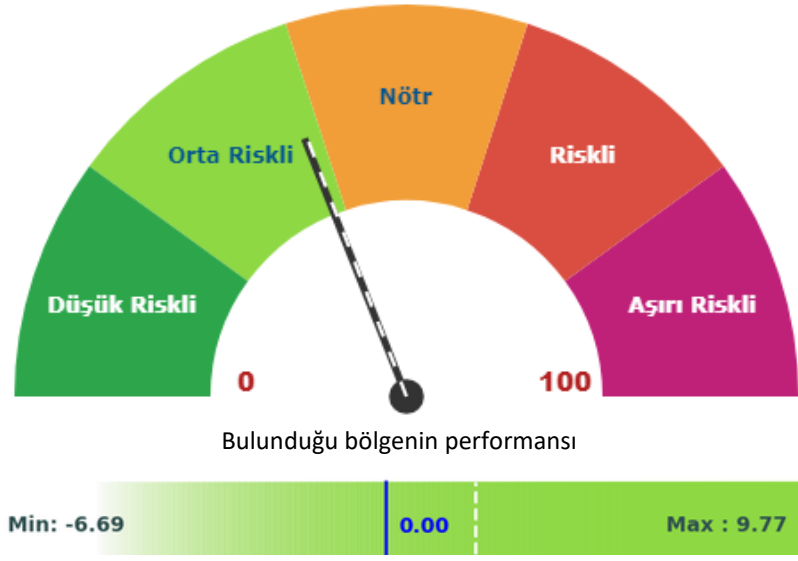
GÜMÜŞ

22 - 28 Nisan 2024

Geçen hafta **orta riskli bölgeye** geçiş yapan Gümüş modeli hafta ortasında nötr bölgeyi test ederek orta riskli bölgeye dönüş yapmıştır.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda Gümüş fiyatları yaklaşık **%15 değer kazanmıştır**.

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

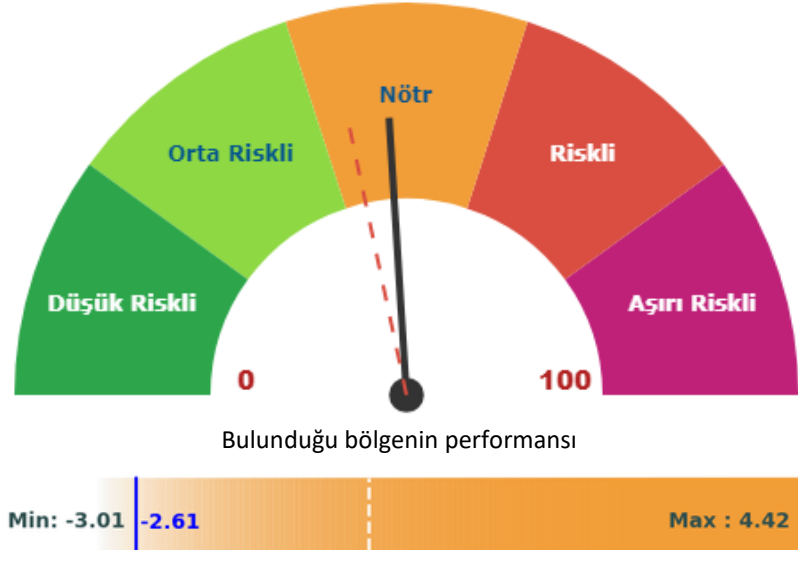


GBPUSD

GBPUSD modeli bu hafta bulunduğu **nötr bölge** içinde riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin nötr sinyal verdiği 1 ayda GBPUSD paritesi yaklaşık **%1.5 değer kaybederken** parite getirisi bu **bölge içinde sağladığı ortalama getiri değerinin altında kalmıştır**.

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

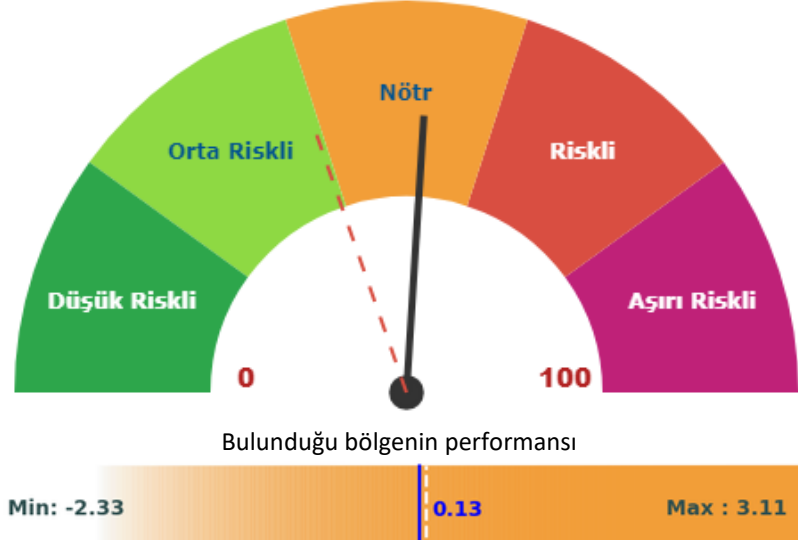


EURUSD

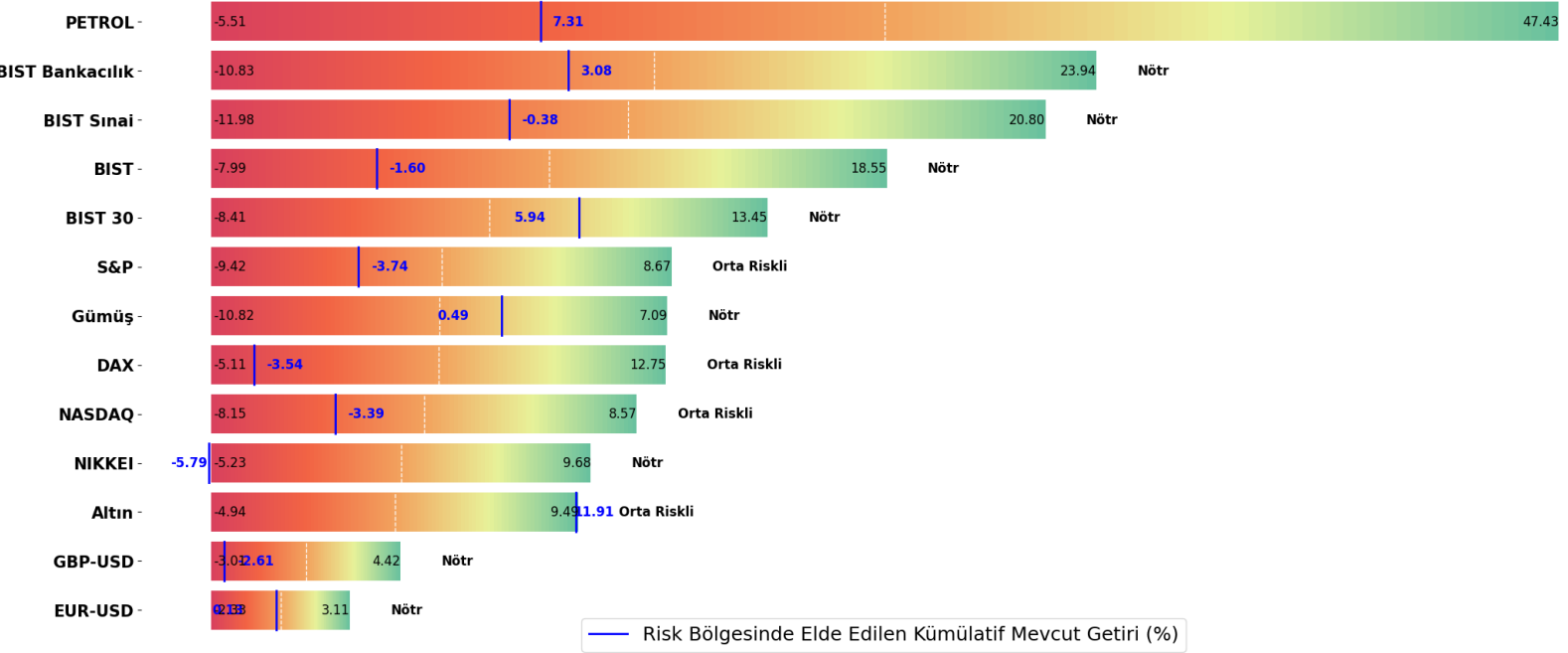
EURUSD modeli hafta başında orta riskli bölgeden nötr bölgeye geçiş yapmıştır.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 ayda EURUSD paritesi yaklaşık **%1.6 değer kaybetmiştir**. Model nötr bölgeye girdiğinden beri **parite getirisi tarihsel ortalamasına ulaşmıştır**.

Bu hafta **52** Bir hafta önce **39** Bir ay önce **35**

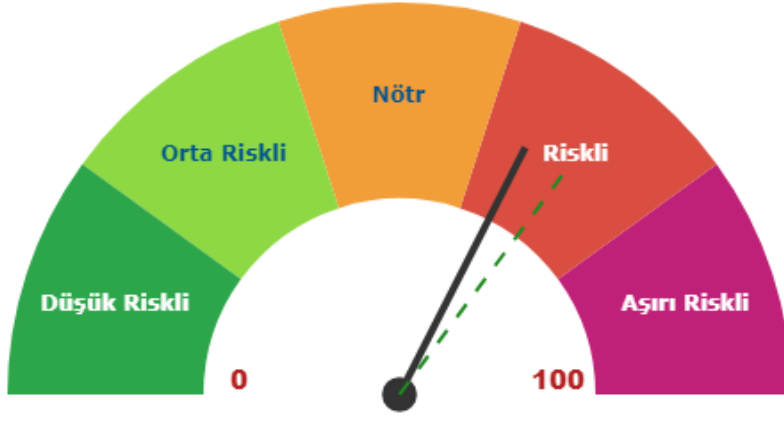


Bulunduğu Bölgeye Göre Getiri Bantları



*Grafikte sunulan veriler, ilgili varlık modelinin mevcut bulunduğu risk bölgesi içerisinde kaydedilen kümülatif minimum ve maksimum getiri oranlarını temsil etmektedir. Kesikli beyaz renkli çizgi ise risk bölgesinde elde ettiği ortalama getiriyi göstermektedir. 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.”