

RİSKOMETRE

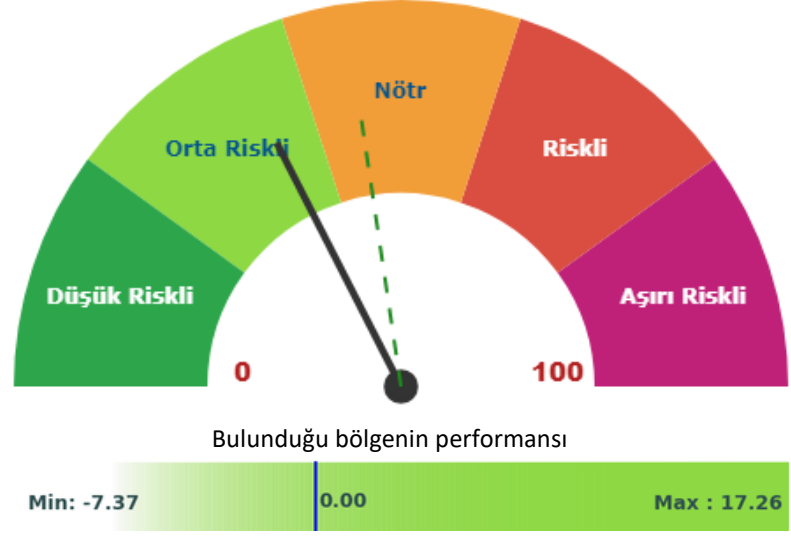
BIST100

25 - 31 Mart 2024

BIST100 modeli bu hafta düşük riskli yöne ilerleyerek nötr bölgeden **orta riskli bölgeye** geçiş yapmıştır.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftalık dönemde yaklaşık **%4 değer kazanan** BIST100 endeksi, modelin riskli yöne ilerlediği 1 ayda yaklaşık **%2 değer kaybetmiştir**.

Bu hafta **35** Bir hafta önce **45** Bir ay önce **27**

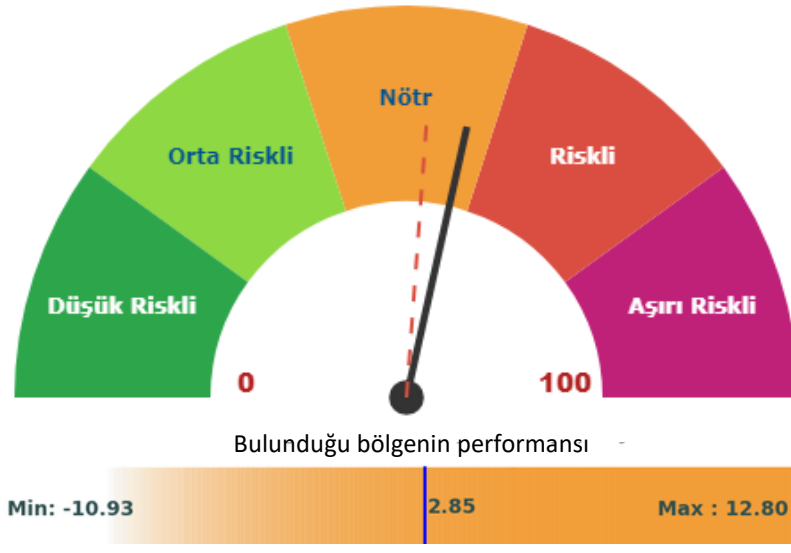


BIST30

BIST30 modeli bu hafta 3 hafta önce geçiş yaptığı **nötr bölge** içinde riskli yöne ilerlemiştir.

BIST30 modeli nötr risk sinyali vermeye devam ederken BIST30 Endeksi 1 haftada yaklaşık **%5 değer kazanmıştır**. Model nötr bölgeye girdiği andan itibaren endeks getirisi tarihsel ortalamasının üzerine ulaşmıştır.

Bu hafta **57** Bir hafta önce **52** Bir ay önce **35**

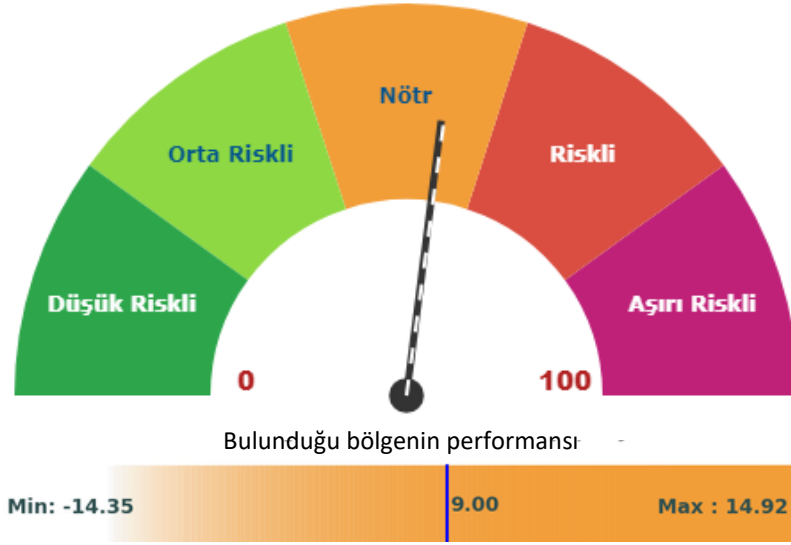


BIST BANKACILIK

BIST Bankacılık Endeksi modeli bu hafta **nötr bölge** içinde konumunu korurken 1 aylık dönemde riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin sabit seyrettiği bu hafta BIST Bankacılık Endeksi yaklaşık **%13 değer kazanmıştır**. Model nötr bölgeye girdiğinden beri endeksin getirisi tarihsel ortalamasının üzerine ulaşmıştır.

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

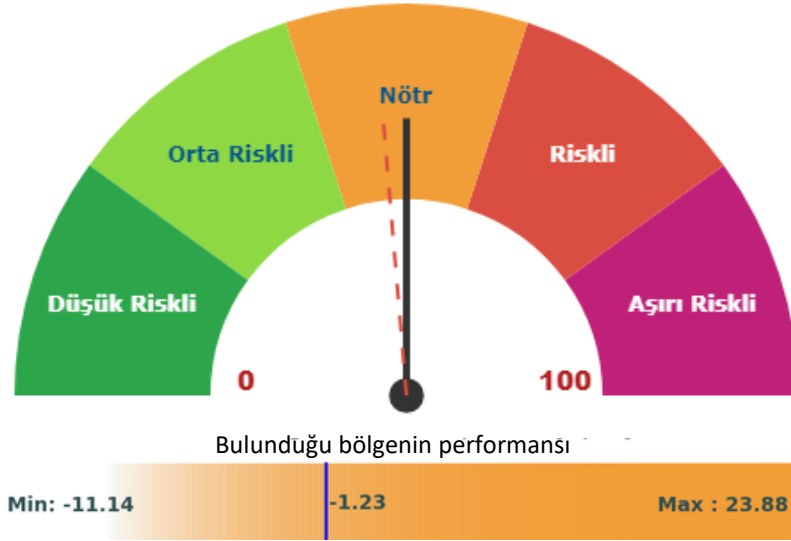


BIST SINAI

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

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 aylık dönemde BIST Sınai Endeksi yaklaşık **%3 değer kaybederek** nötr bölgedeki tarihsel ortalamasının altında bir performans sergilemiştir.

Bu hafta **50** Bir hafta önce **47** Bir ay önce **38**

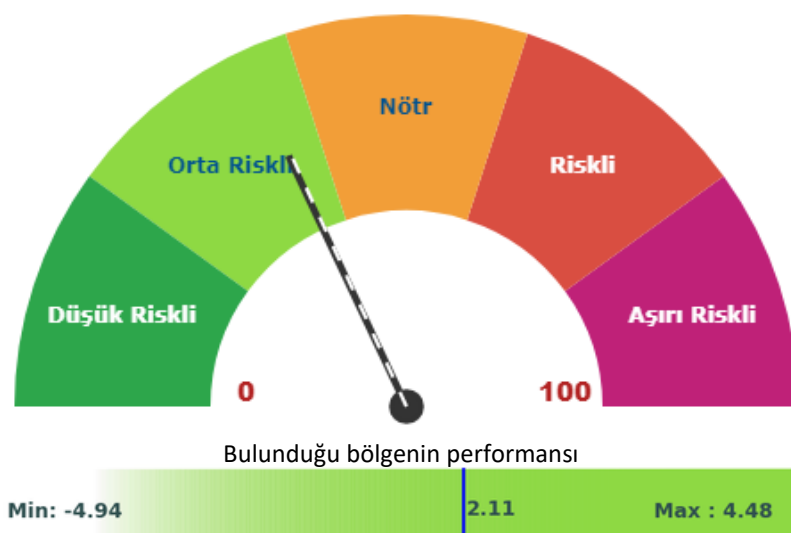


ALTIN

Altın modeli bu hafta **orta riskli bölge** içinde konumunu korurken 1 ayda düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda Altın fiyatları yaklaşık **%6.5 değer kazanmış** ve getirisi bulunduğu bölgenin tarihsel ortalamasının üzerine ulaşmıştır.

Bu hafta **36** Bir hafta önce **36** Bir ay önce **48**



RİSKOMETRE

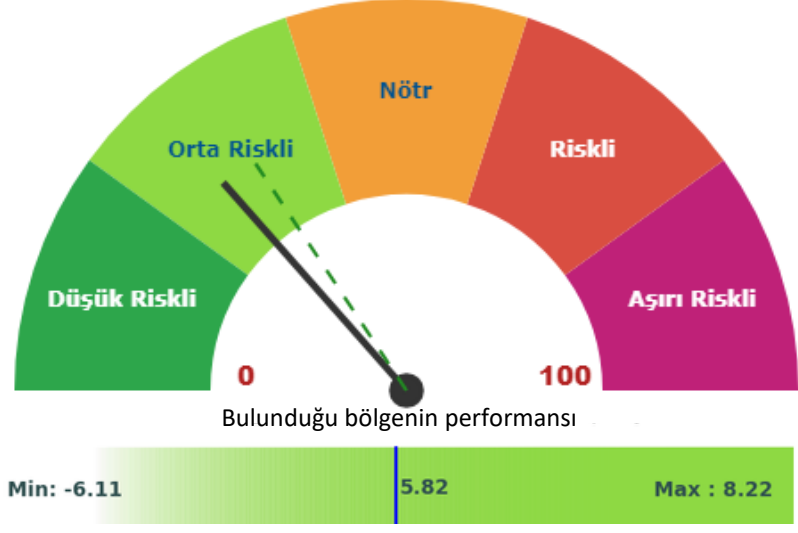
S&P

25 - 31 Mart 2024

ABD Hisse Senedi modeli bu hafta **orta riskli bölge** içinde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin orta risk sinyali verdiği 1 aylık dönemde S&P Endeksi yaklaşık **%3 değer kazanmış** ve orta riskli bölgede bulunduğu 5 haftada getirisi bu bölgenin tarihsel ortalamasının üzerine ulaşmıştır.

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

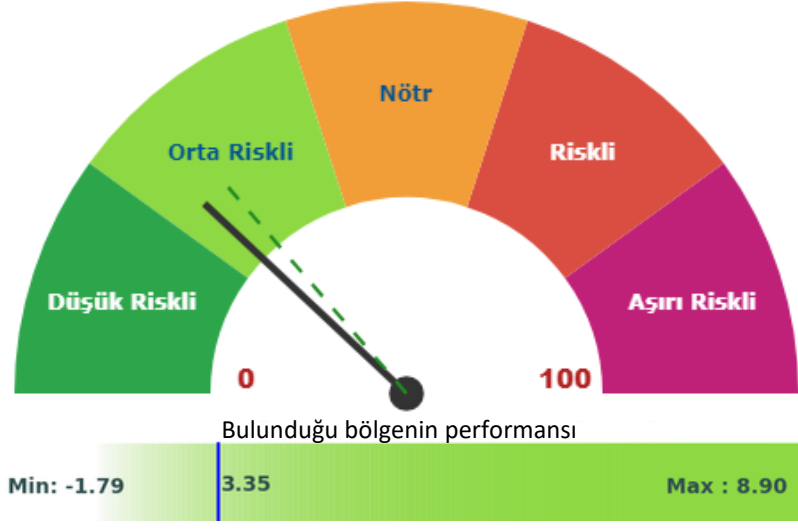


NASDAQ

NASDAQ modeli 1 haftalık ve 1 aylık dönemde **orta riskli bölge** içinde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

NASDAQ Endeksi, modelin orta risk sinyali verdiği 1 aylık dönemde yaklaşık **%3 getiri** sağlamıştır.

Bu hafta **24** Bir hafta önce **27** Bir ay önce **31**

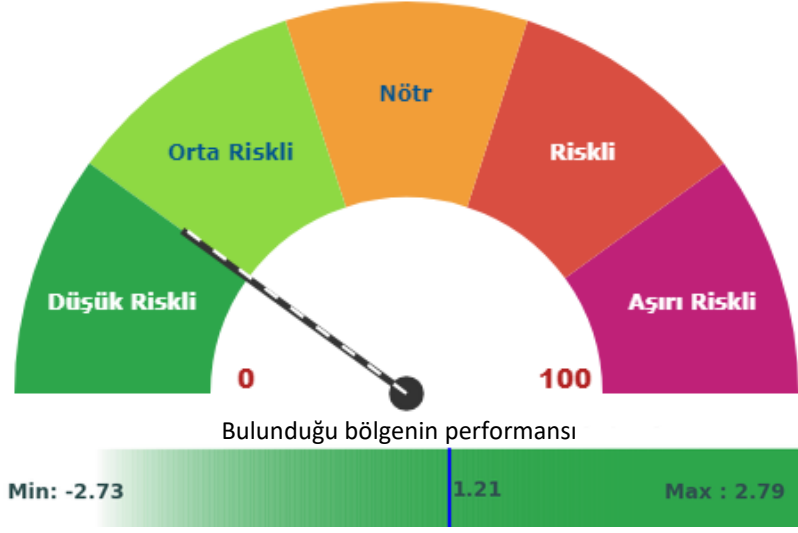


DAX

Almanya Hisse Senedi modeli, 10 gün önce **düşük riskli bölgeye** geçtiğinden beri sabit bir seyir izlemiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda DAX Endeksi yaklaşık **%4.5 değer kazanmış** ve düşük riskli bölgeye girdiğinden beri getirisi bölge ortalamasının üzerinde seyretmiştir.

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

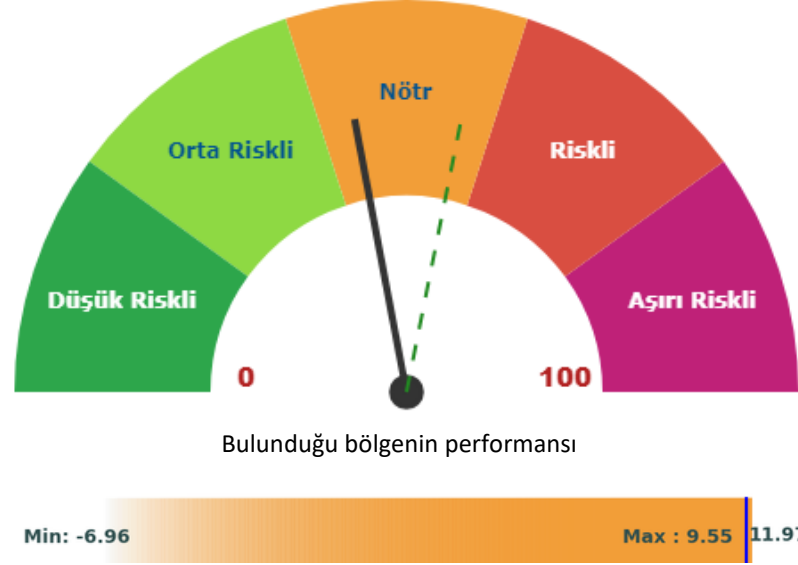


NIKKEI

Japonya Hisse Senedi modeli yaklaşık 2 aydır **nötr bölge** içinde yer alırken bu hafta düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada yaklaşık **%6 getiri** sağlayan Nikkei Endeksi nötr bölge içinde bulunduğu dönemde sağladığı maksimum getiri miktarının üzerine çıkmıştır.

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

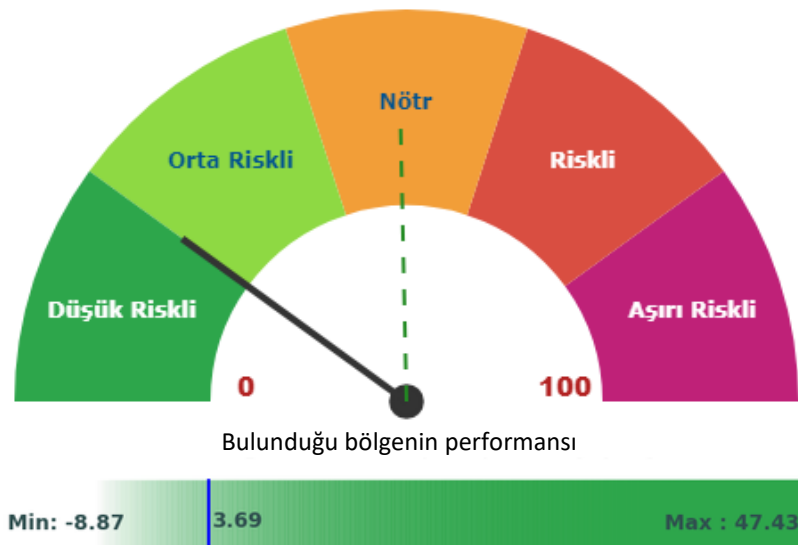


PETROL

Petrol modeli bu hafta bulunduğu nötr bölgeden **düşük riskli bölge** sınırına geçiş yapmıştır.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 aylık dönemde Petrol fiyatları yaklaşık **%5 değer kazanmıştır**.

Bu hafta **20** Bir hafta önce **49** Bir ay önce **50**



RİSKOMETRE

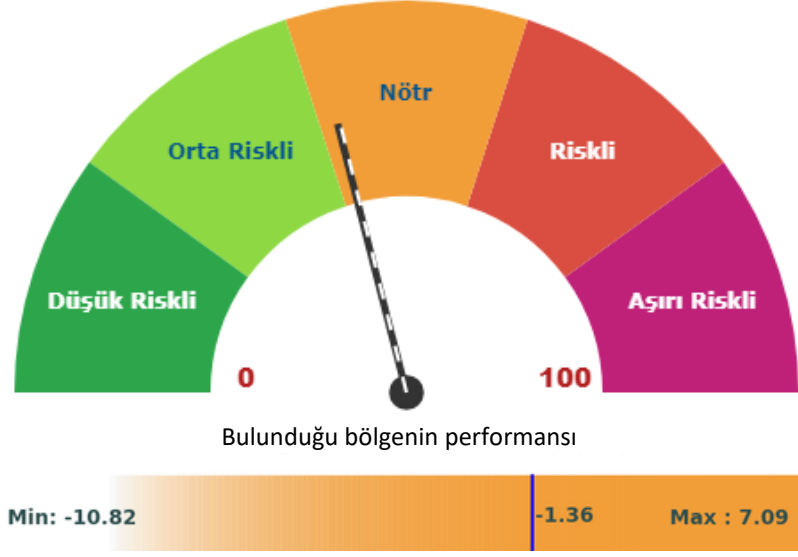
GÜMÜŞ

25 - 31 Mart 2024

Yaklaşık 5 haftadır **nötr bölge** içinde bulunan Gümüş modeli bu hafta konumunu korumuştur.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda Gümüş fiyatları yaklaşık **%6.5 değer kazanmıştır**.

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

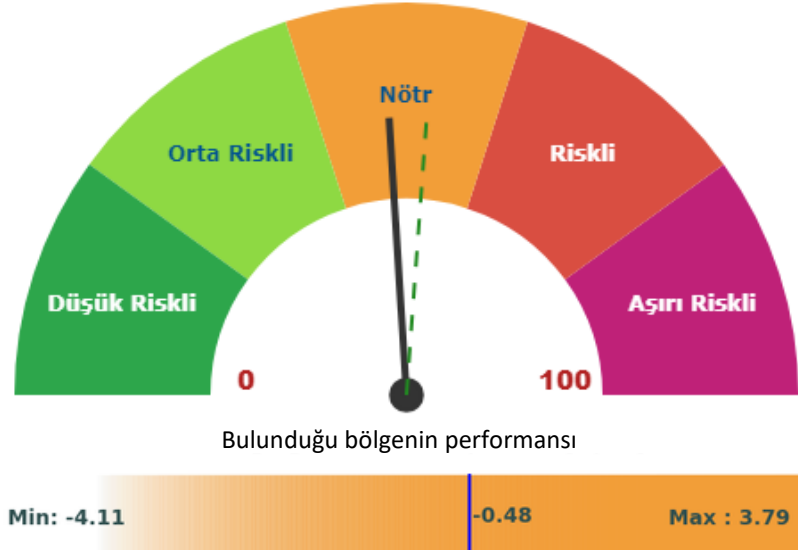


GBPUSD

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

Modelin nötr sinyal verdiği 1 haftada yaklaşık **%1 değer kaybeden** GBPUSD paritesi bu bölge içinde sağladığı ortalama getiri değerine ulaşmıştır.

Bu hafta **48** Bir hafta önce **52** Bir ay önce **43**

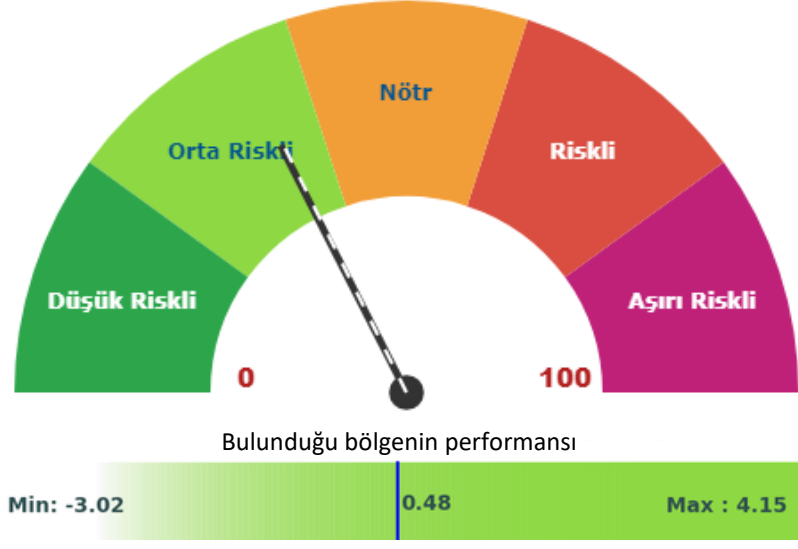


EURUSD

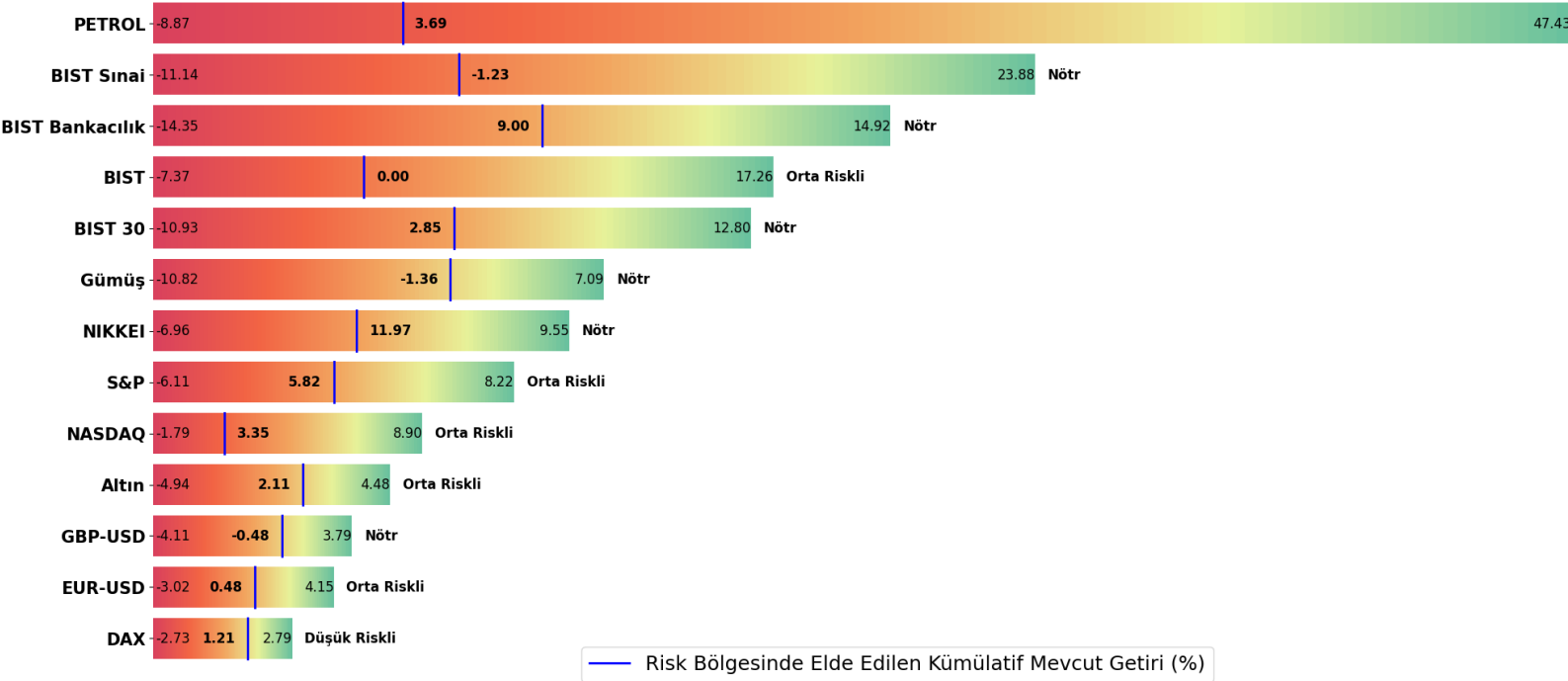
EURUSD modeli bu hafta **orta riskli bölge** içinde konumunu korumuştur.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 ayda EURUSD paritesi yaklaşık **%0.5 değer kaybetmiştir**.

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

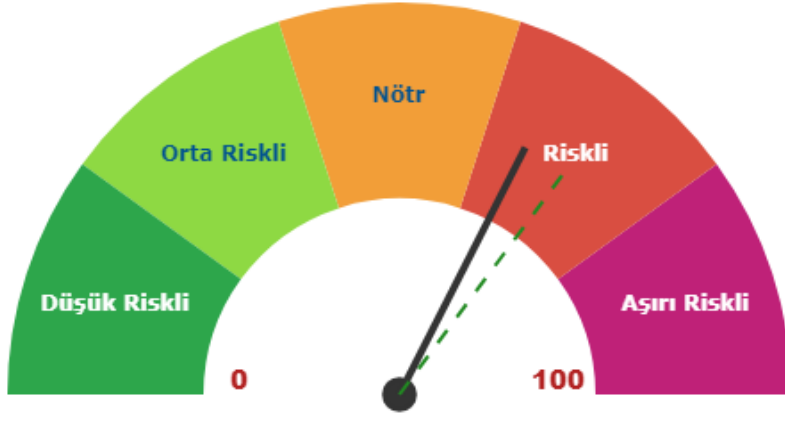


Bulunduğu Bölgeye Göre Getiri Bantları



*Grafikte sunulan veriler, ilgili varlık modelinin mevcut bulunduğu risk bölgesi içerisinde kaydedilen kümülatif minimum ve maksimum getiri oranlarını temsil etmektedir. 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.”