

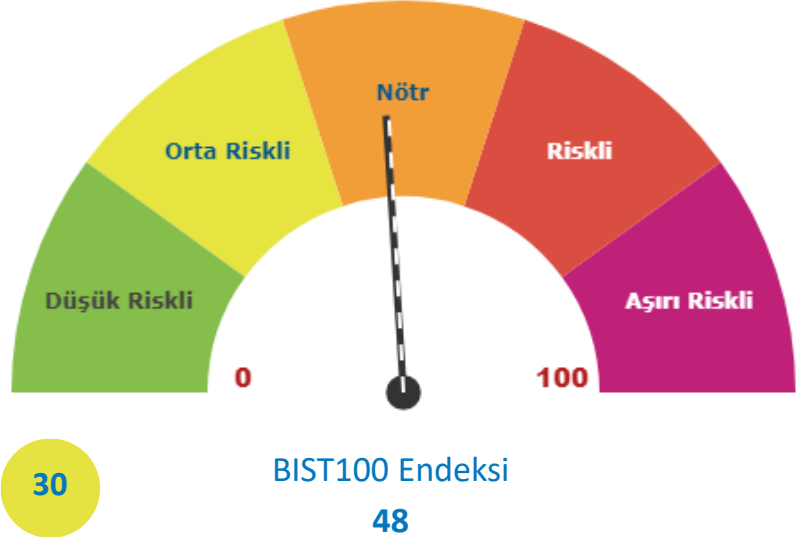
RİSKOMETRE

BIST100

29 Ocak - 4 Şubat 2024

BIST100 modeli 1 aylık dönemde orta riskli bölgeden **nötr bölgeye** geçmiştir.

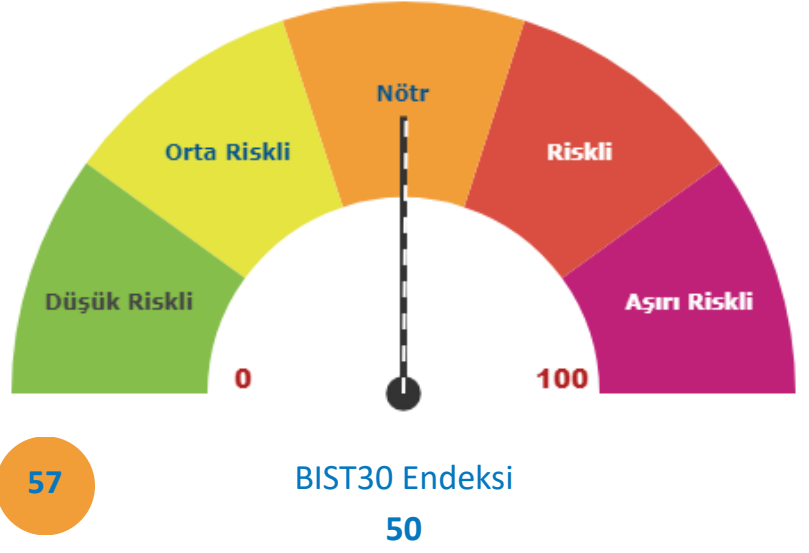
Piyasanın risk algısının artmasına rağmen BIST100 Endeksi 1 ayda **%9'luk artış** göstermiştir.



BIST30

BIST30 modeli 1 ayda **nötr bölge** içinde düşük riskli yöne ilerlerken, bu hafta stabil seyretmiştir.

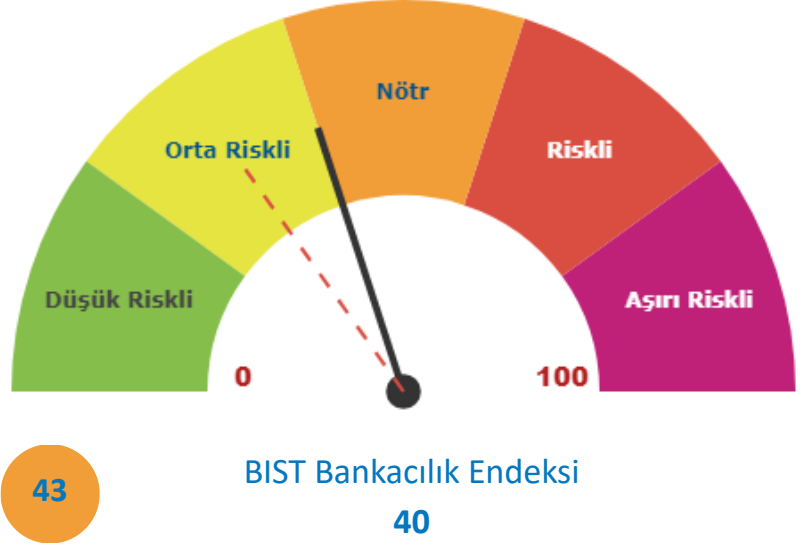
Modelin konumunu koruduğu 1 haftada BIST30 Endeksi **%2**, düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda ise yaklaşık **%9.5 getiri** sağlamıştır.



BIST BANKACILIK

BIST Bankacılık modeli bu hafta **orta riskli bölge** içinde nötr bölge sınırına ilerlemiştir.

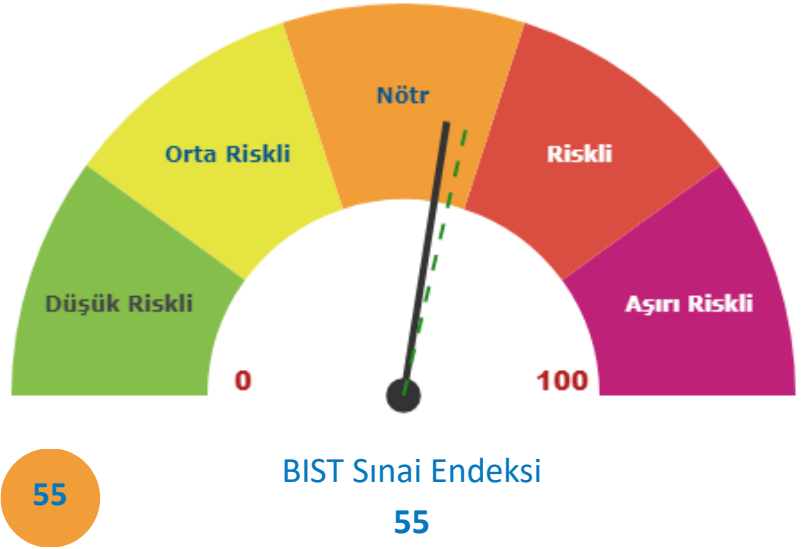
Modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftada BIST Bankacılık Endeksi **%1.5 değer kaybetmiş**, düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda ise yaklaşık **%9 değer kazanmıştır**.



BIST SINAI

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

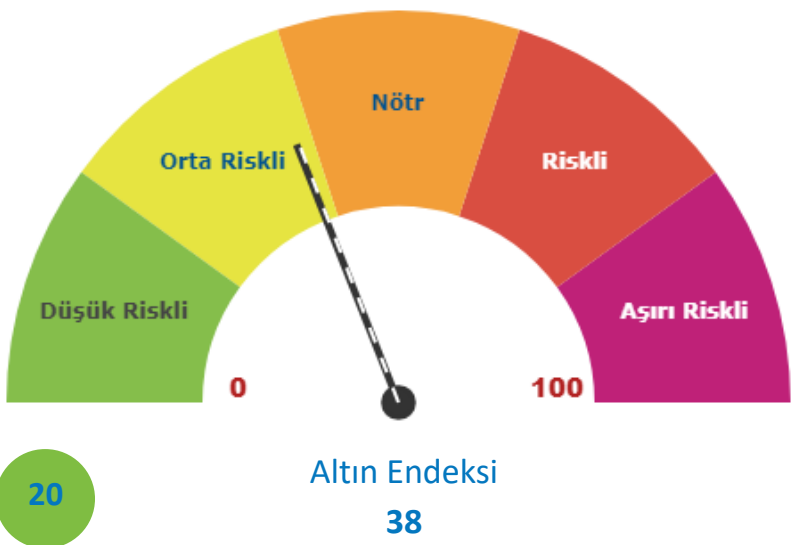
Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada BIST Sınai Endeksi yaklaşık **%4**, daha dalgalı seyrettiği 1 ayda ise yaklaşık **%7.5 getiri** sağlamıştır.



ALTIN

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

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 aylık dönemde Altın fiyatları yaklaşık **%2 değer kaybı** yaşamıştır.



RİSKOMETRE

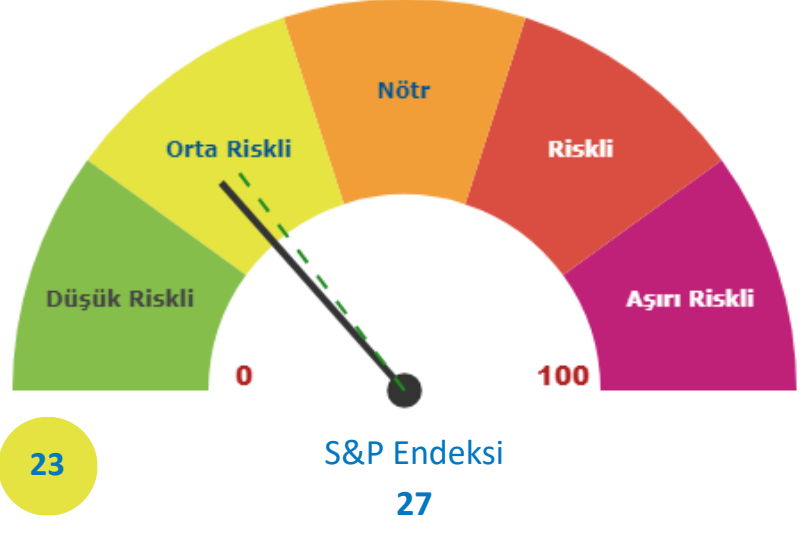
S&P

29 Ocak - 4 Şubat 2024

ABD Hisse Senedi modeli 1 haftalık ve 1 aylık dönemde **orta riskli bölge** içinde yer alırken bu hafta düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada S&P Endeksi yaklaşık **%1.5 getiri** sağlamıştır.

Bu hafta **27** Bir hafta önce **29** Bir ay önce **23**

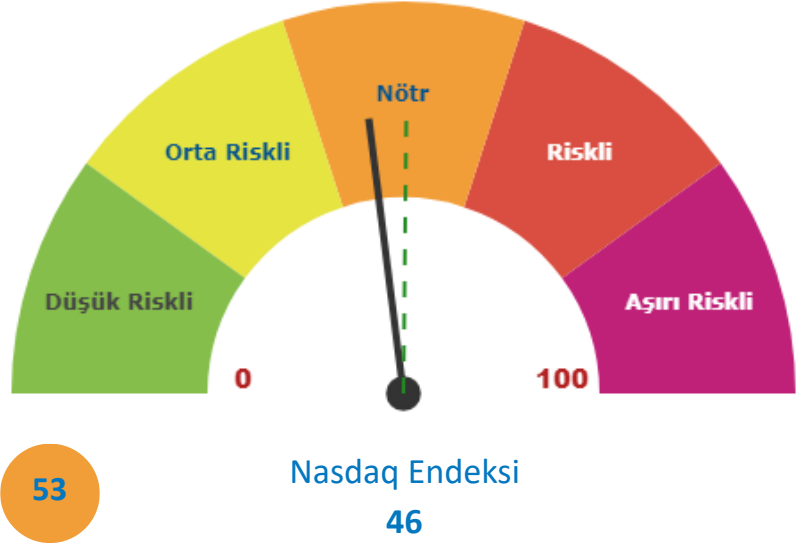


NASDAQ

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

Model düşük riskli yöne ilerlerken 1 haftada NASDAQ Endeksinde yaklaşık **%1.5**, 1 ayda ise yaklaşık **%4.5 getiri** gözlenmiştir.

Bu hafta **46** Bir hafta önce **50** Bir ay önce **53**

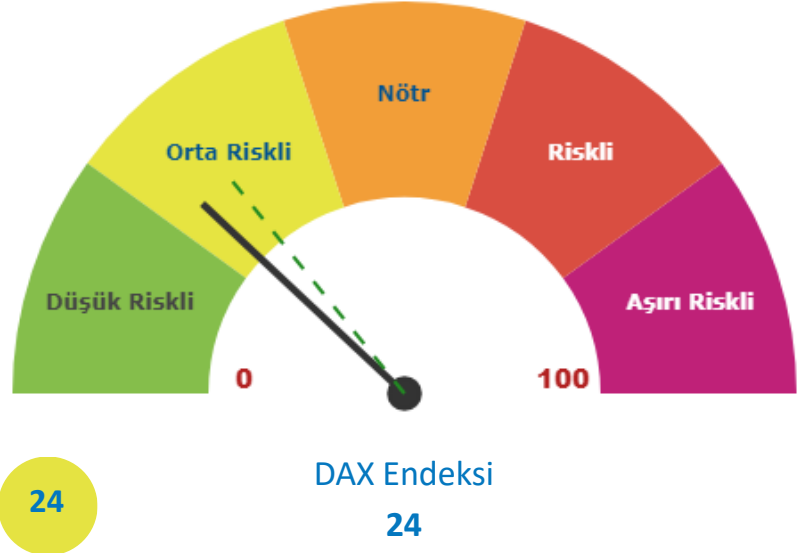


DAX

Almanya Hisse Senedi modeli 1 aydır **orta riskli bölge** içinde bulunurken bu hafta düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada DAX Endeksi yaklaşık **%2 değer** kazanmıştır.

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

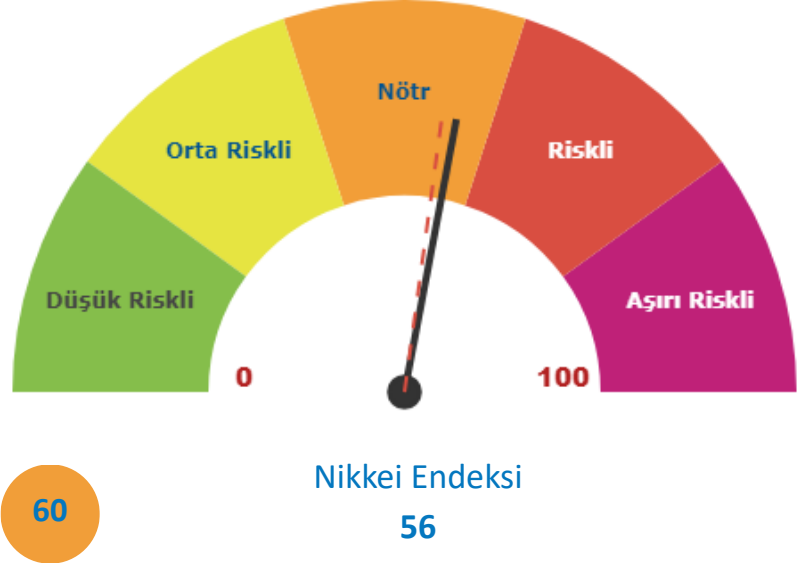


NIKKEI

Japonya Hisse Senedi modeli 1 aylık dönemde **nötr bölge** içinde düşük riskli yöne ilerlerken bu hafta yönünü riskli tarafa çevirmiştir.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftada NIKKEI Endeksi yaklaşık **%1 değer kaybı** yaşamış, düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda ise yaklaşık **%7 değer kazanmıştır**.

Bu hafta **56** Bir hafta önce **54** Bir ay önce **60**

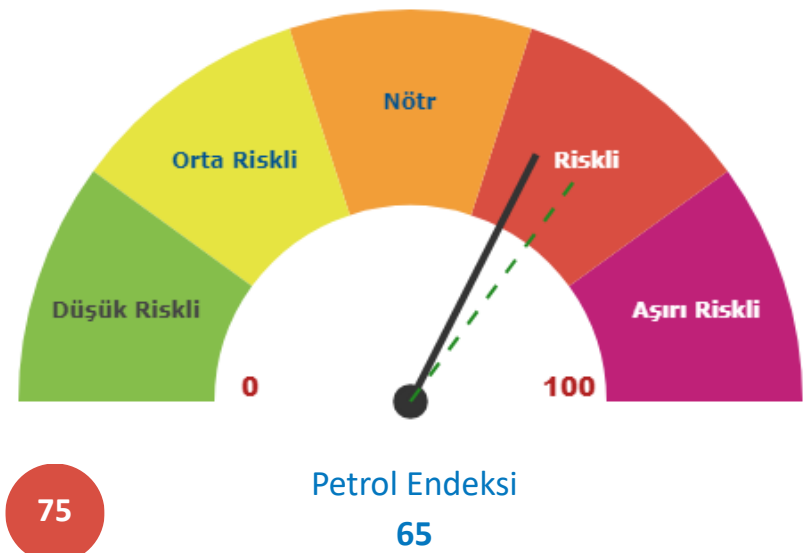


PETROL

Petrol modeli 1 aylık ve 1 haftalık dönemde **riskli bölge** içinde düşük riskli yönde hareketini sürdürmektedir.

Modelin 1 haftalık düşük riskli yönde hareketi süresince Petrol fiyatları yaklaşık **%4.5**, 1 aylık dönemde ise yaklaşık **%7 değer kazanmıştır**.

Bu hafta **65** Bir hafta önce **70** Bir ay önce **75**



RİSKOMETRE

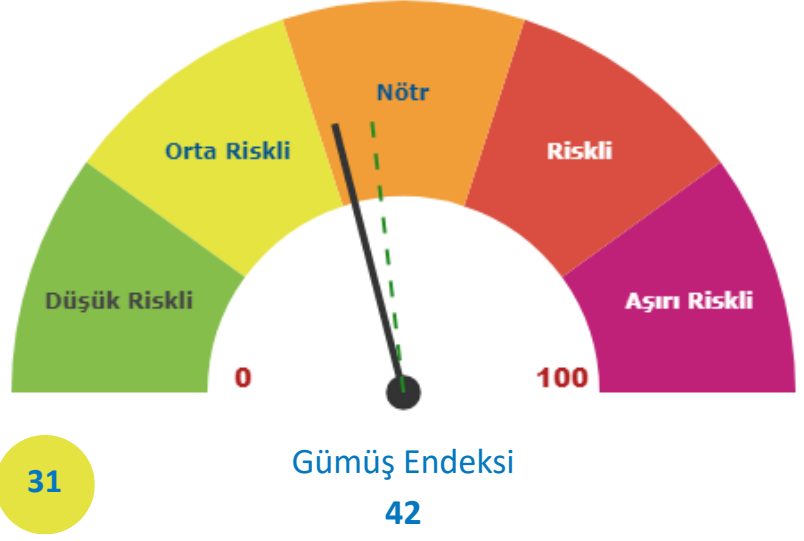
GÜMÜŞ

29 Ocak - 4 Şubat 2024

Gümüş modeli 1 haftada, geçen hafta geçiş yaptığı **nötr** bölge içinde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftalık dönemde Gümüş fiyatlarında yaklaşık **%1.5 getiri**, riskli yöne ilerlediği 1 ayda ise yaklaşık **%4 değer kaybı** gözlenmiştir.

Bu hafta **42** Bir hafta önce **46** Bir ay önce **31**

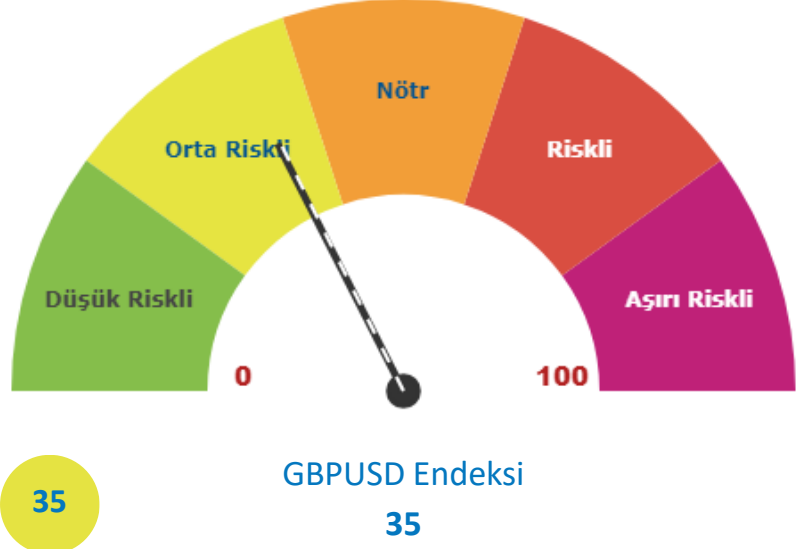


GBPUSD

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

Modelin nötr bölge sınırını test ettiği 1 aylık dönemde GBPUSD paritesi yaklaşık **%0.5 değer kaybı** yaşamıştır.

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

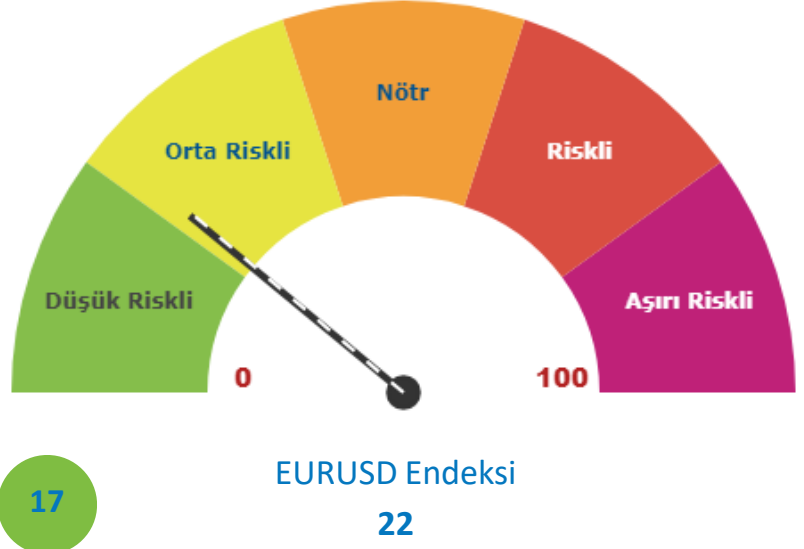


EURUSD

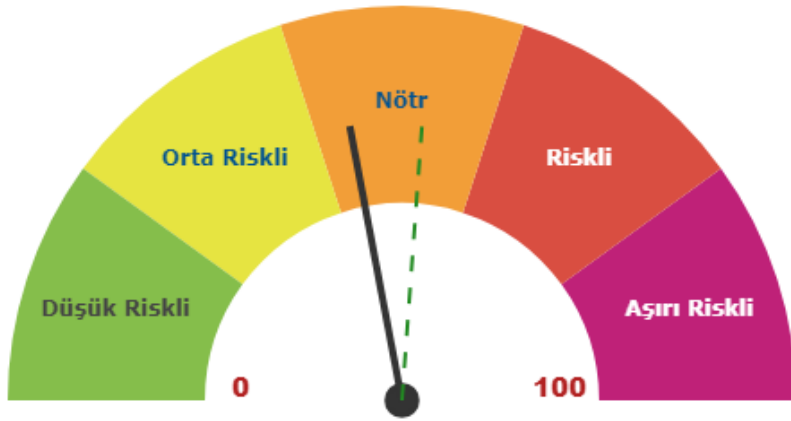
EURUSD modeli bulunduğu **orta riskli** bölgede konumunu korumaktadır.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 aylık dönemde EURUSD paritesi yaklaşık **%2 değer kaybetmiştir**.

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



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."