

# RİSKOMETRE

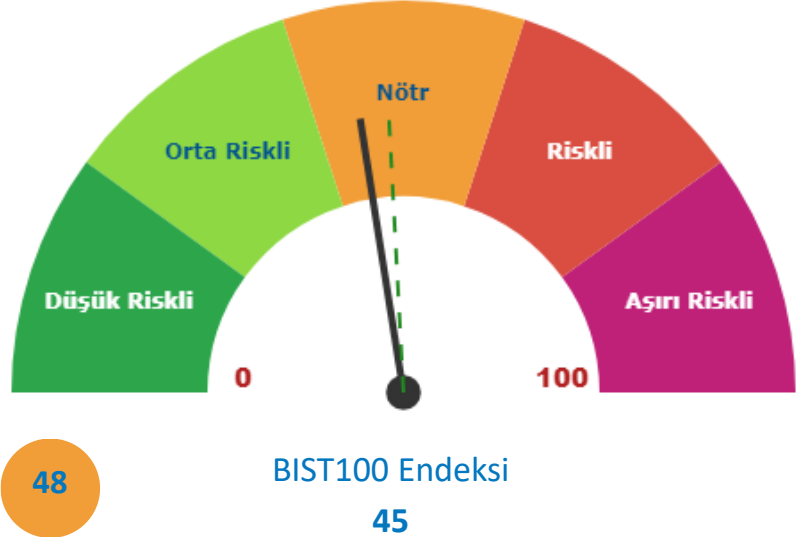
## BIST100

5 - 11 Şubat 2024

BIST100 modeli 1 aylık dönemde **nötr bölgede** bulunurken bu hafta düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada BIST100 Endeksinde yaklaşık **%4.5**, 1 ayda ise yaklaşık **%14** getiri gözlenmiştir.

Bu hafta **45** Bir hafta önce **48** Bir ay önce **48**



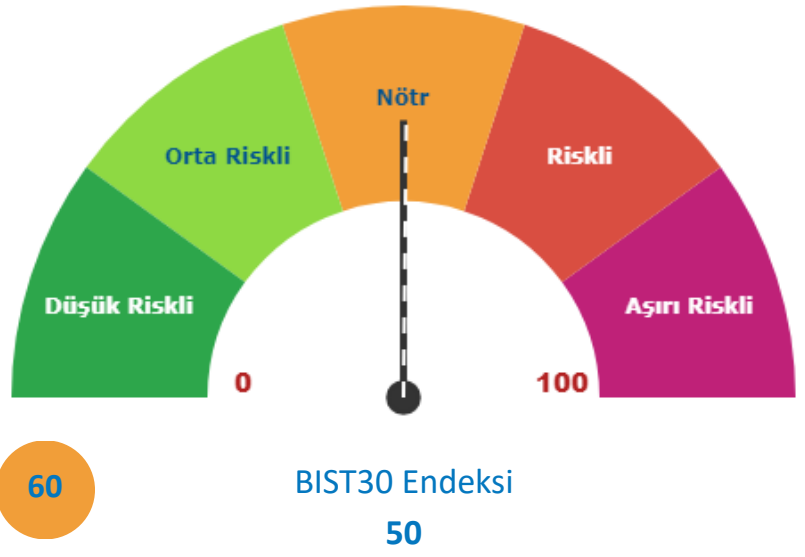
BIST100 Endeksi  
45

## BIST30

BIST30 modeli 1 aylık dönemde **nötr bölge** içinde düşük riskli yöne ilerlerken, bu hafta konumunu korumuştur.

Modelin stabil seyrettiği 1 haftada BIST30 Endeksi yaklaşık **%4**, düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda ise yaklaşık **%14** getiri sağlamıştır.

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



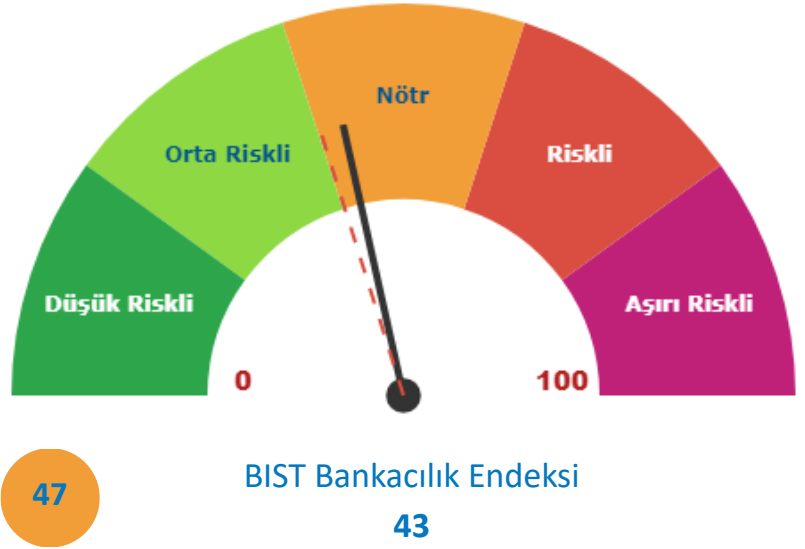
BIST30 Endeksi  
50

## BIST BANKACILIK

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

BIST Bankacılık endeksi, piyasanın risk algısının arttığı 1 haftalık dönemde **%2**, düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda ise yaklaşık **%10** değer kazanmıştır.

Bu hafta **43** Bir hafta önce **40** Bir ay önce **47**



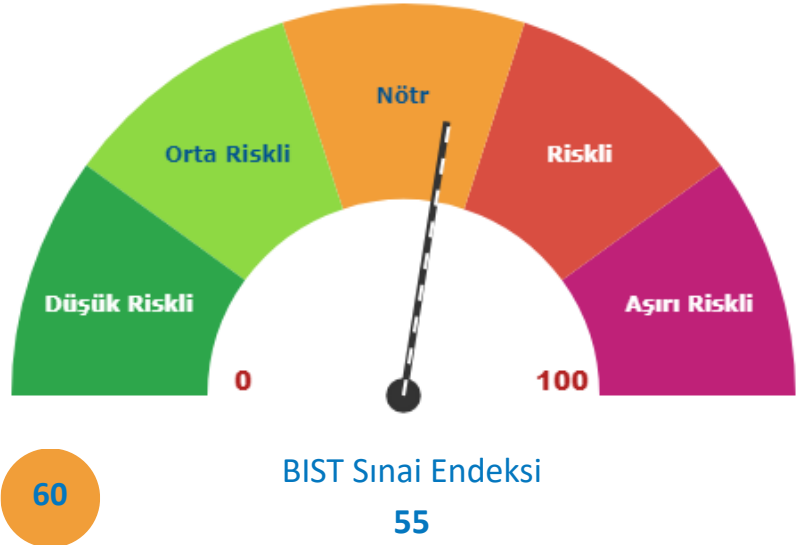
BIST Bankacılık Endeksi  
43

## BIST SINAI

BIST Sınai Endeksi modeli 1 aylık dönemde **nötr bölge** içinde düşük riskli yöne ilerlerken bu hafta stabil seyretmiştir.

Modelin nötr risk sinyali verdiği 1 haftada BIST Sınai Endeksi yaklaşık **%5.5**, düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda ise yaklaşık **%13** getiri sağlamıştır.

Bu hafta **55** Bir hafta önce **55** Bir ay önce **60**



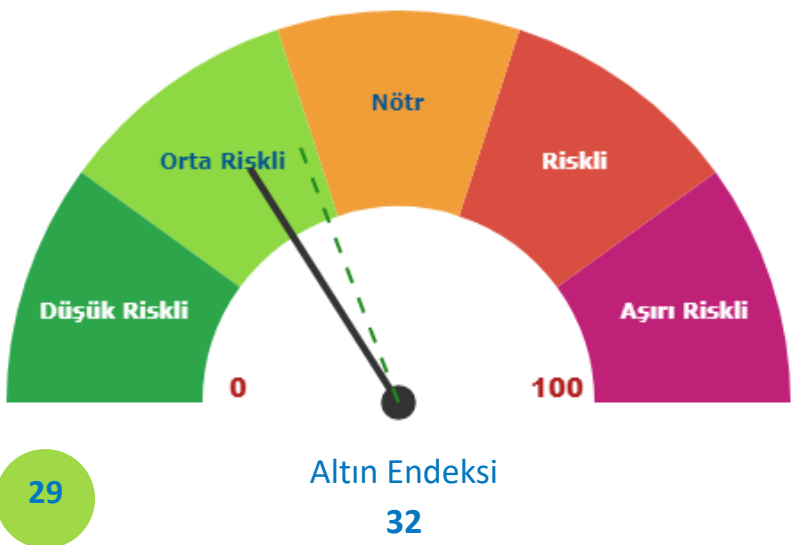
BIST Sınai Endeksi  
55

## ALTIN

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

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftalık dönemde Altın fiyatları yaklaşık **%2** değer kazanmış, 1 ayda ise stabil kalmıştır.

Bu hafta **32** Bir hafta önce **38** Bir ay önce **29**



Altın Endeksi  
32

# RİSKOMETRE

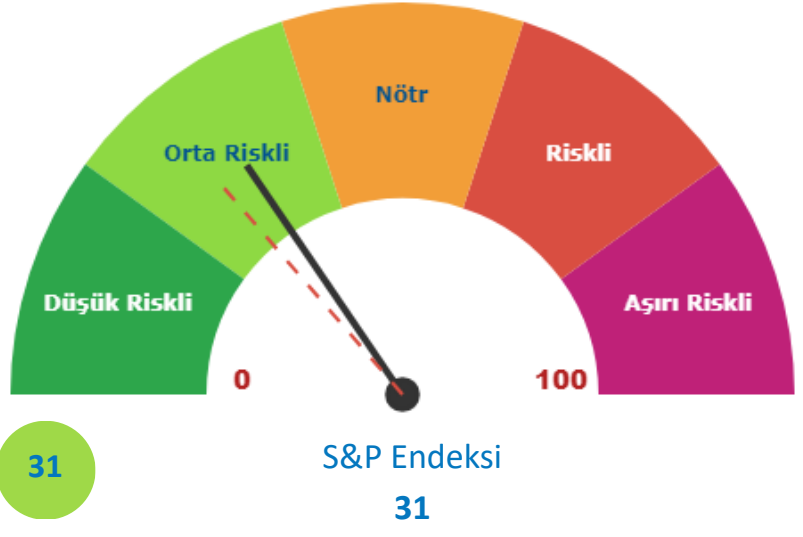
S&P

5 - 11 Şubat 2024

ABD Hisse Senedi modeli 1 aydır **orta riskli bölge** içinde yer alırken bu hafta riskli yöne ilerleyerek 1 ay önceki konumuna dönüş yapmıştır.

Modelin orta riskli bölgede kaldığı 1 aylık dönemde S&P Endeksi yaklaşık **%4.5 getiri** sağlamıştır.

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

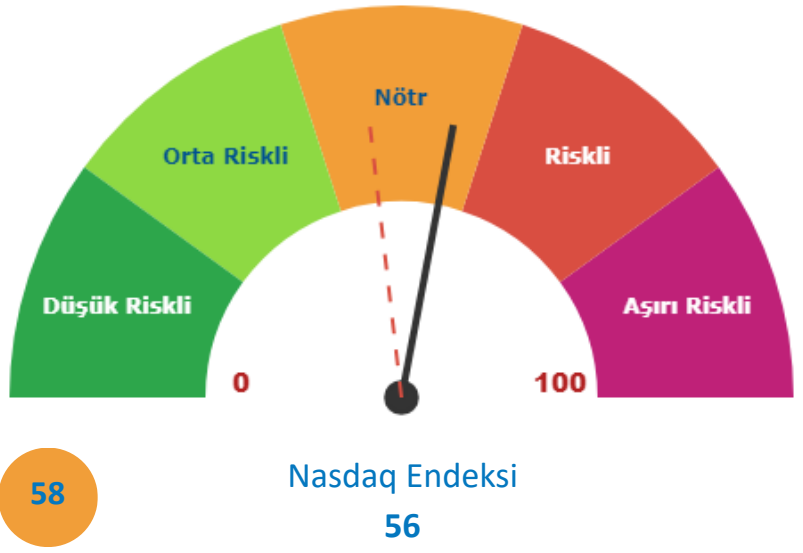


## NASDAQ

NASDAQ modeli bu hafta **nötr bölge** içinde riskli yöne ilerleyerek 1 ay önce bulunduğu seviyeye yaklaşmıştır.

Piyasanın risk algısının arttığı 1 haftada NASDAQ Endeksi'nin getirisi sabit kalmıştır.

Bu hafta **56** Bir hafta önce **46** Bir ay önce **58**

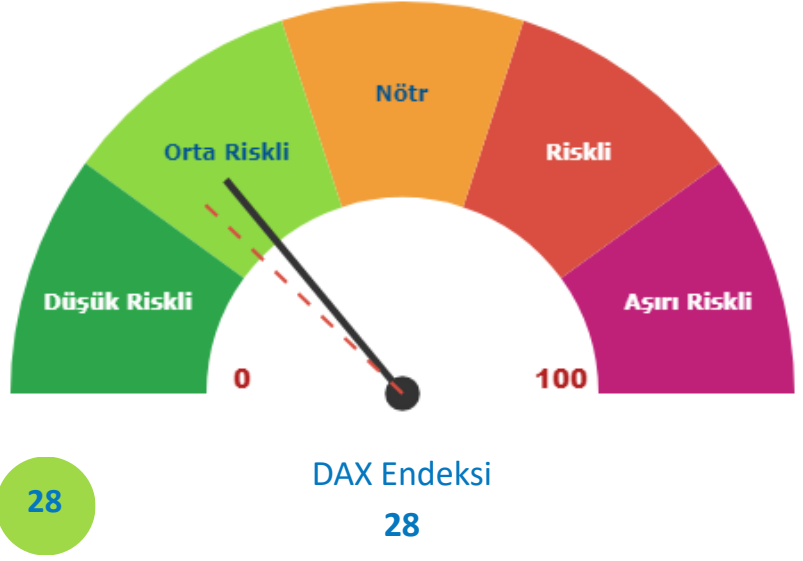


## DAX

Almanya Hisse Senedi modeli bu hafta bulunduğu **orta riskli bölge** içinde riskli yöne ilerleyerek 1 ay önceki konumuna dönüş yapmıştır.

Modelin dalgalı seyrettiği 1 ayda DAX Endeksi yaklaşık **%2 değer kazanmıştır**.

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

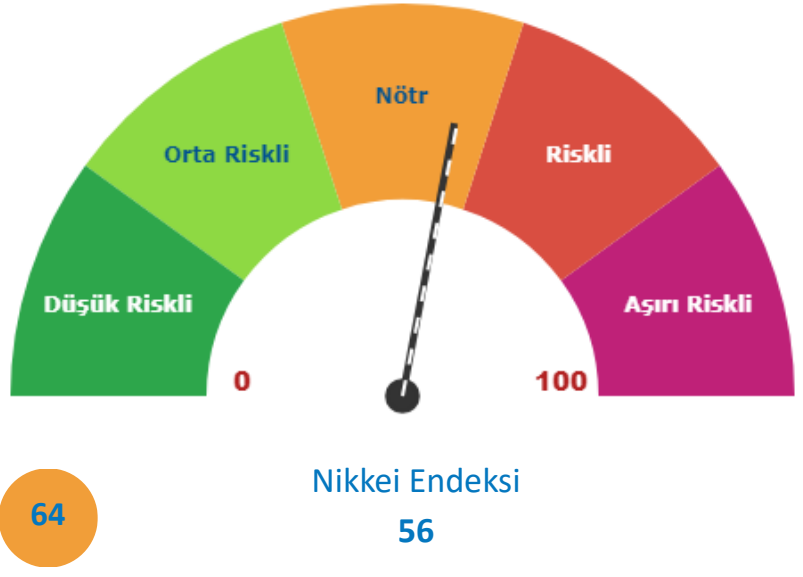


## NIKKEI

Japonya Hisse Senedi modeli 1 aylık dönemde **nötr bölge** içinde düşük riskli yöne ilerlemiş, bu hafta ise sabit kalmıştır.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği son 1 ayda NIKKEI Endeksi yaklaşık **%8.5 değer kazanmıştır**.

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

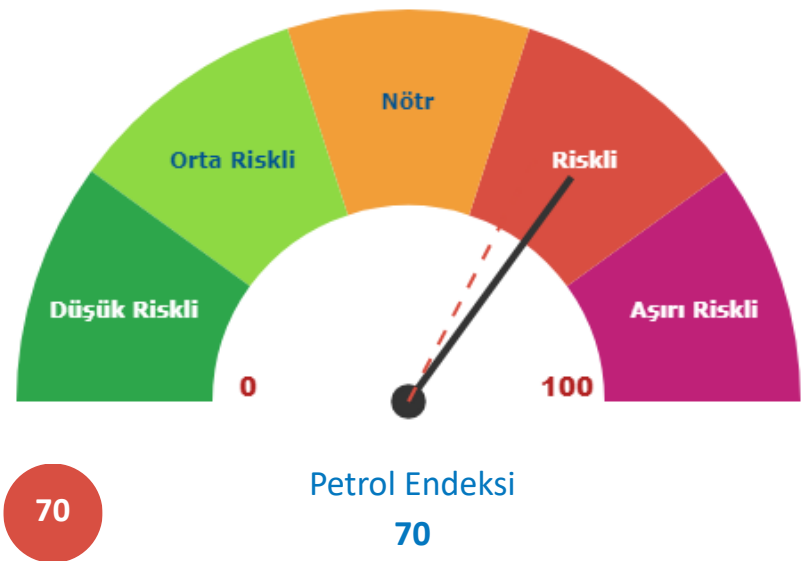


## PETROL

Petrol modeli 1 aylık dönemde **riskli bölge** içinde bulunmaya devam ederken bu hafta riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin 1 haftalık riskli yönde hareketi süresince Petrol fiyatları yaklaşık **%5.5 değer kaybetmiştir**.

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



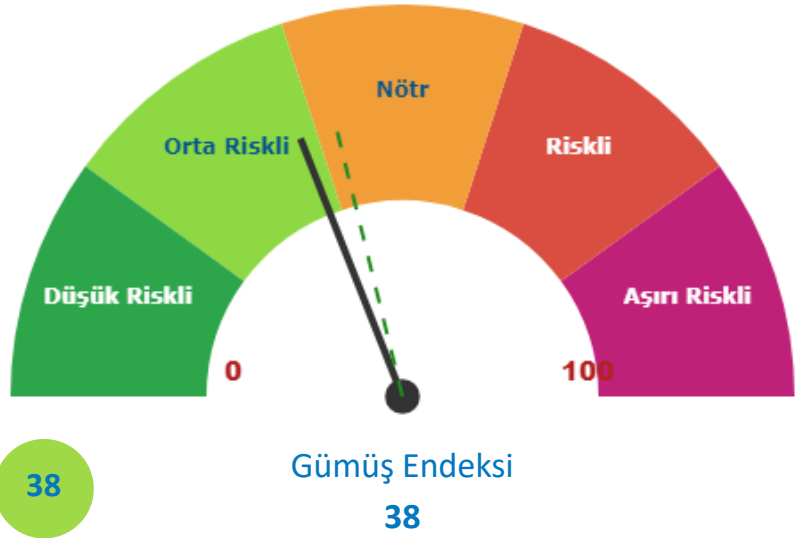
# RİSKOMETRE

## GÜMÜŞ

5 - 11 Şubat 2024

Gümüş modeli 2 haftadır test ettiği nötr bölgeden **orta riskli bölgeye** dönüş yapmıştır.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftalık dönemde Gümüş fiyatlarında yaklaşık **%2 getiri** gözlenmiştir.

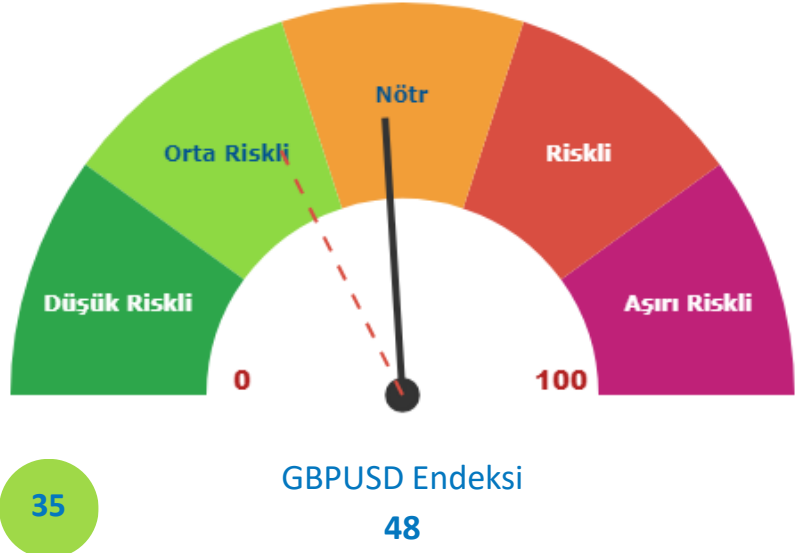


Bu hafta **38** Bir hafta önce **42** Bir ay önce **38**

## GBPUSD

GBPUSD modeli uzun bir aradan sonra **nötr bölgeye** geçiş yapmıştır.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 aylık dönemde GBPUSD paritesi yaklaşık **%1 değer kaybı** yaşamıştır.

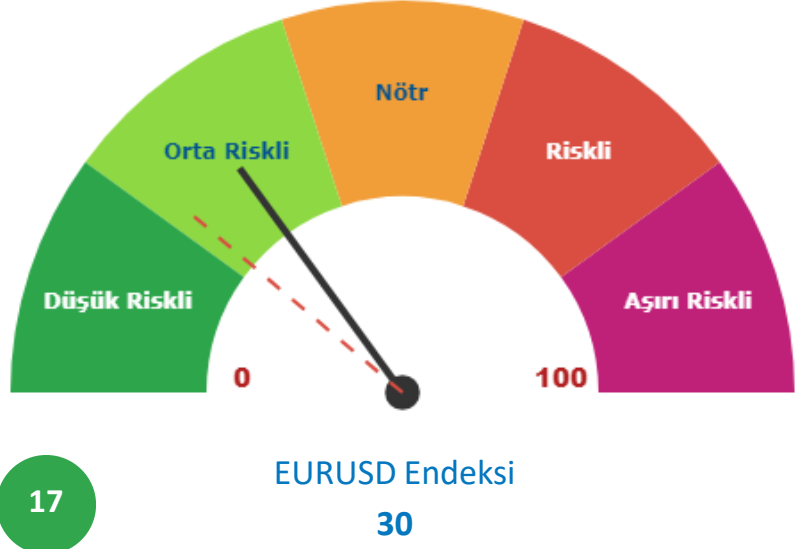


Bu hafta **48** Bir hafta önce **35** Bir ay önce **35**

## EURUSD

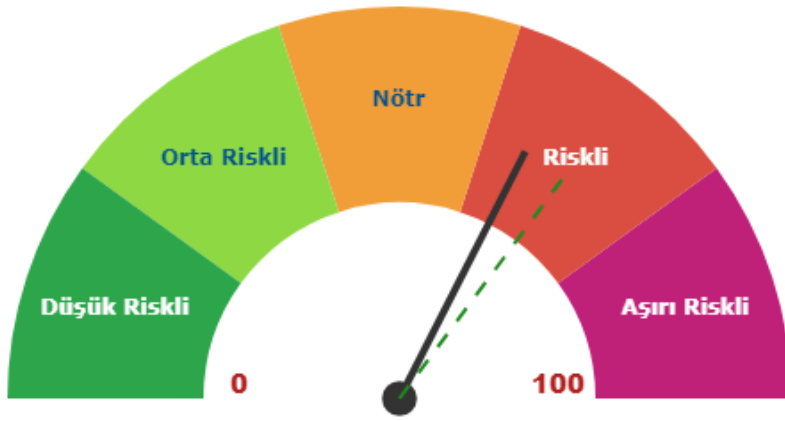
EURUSD modeli 1 aylık ve 1 haftalık dönemde **orta riskli** bölge içinde riskli yöne ilerlemiştir.

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



Bu hafta **30** 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](http://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."