

# RİSKOMETRE

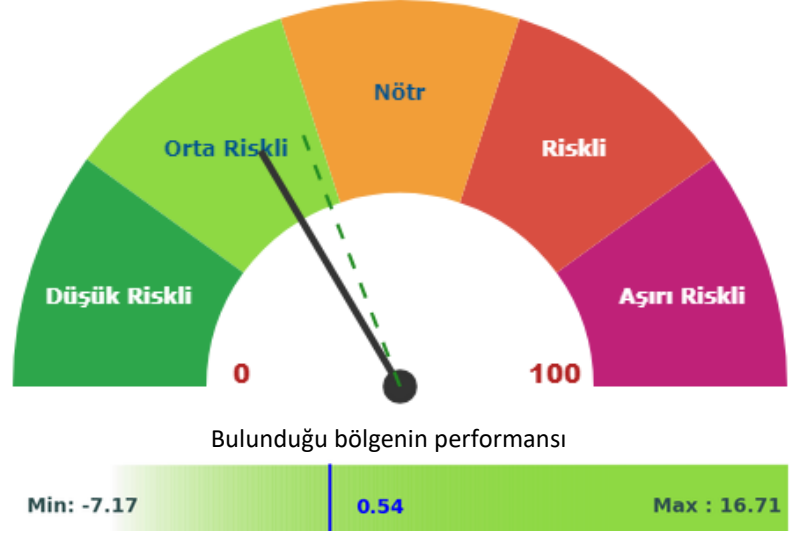
BIST100

8 - 14 Nisan 2024

BIST100 modeli bu hafta **orta riskli bölge** içinde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Model orta riskli bölgeye giriş yaptığından beri endeks getirisi **tarihsel ortalamasının altında seyretmektedir.**

Bu hafta **33** Bir hafta önce **38** Bir ay önce **45**

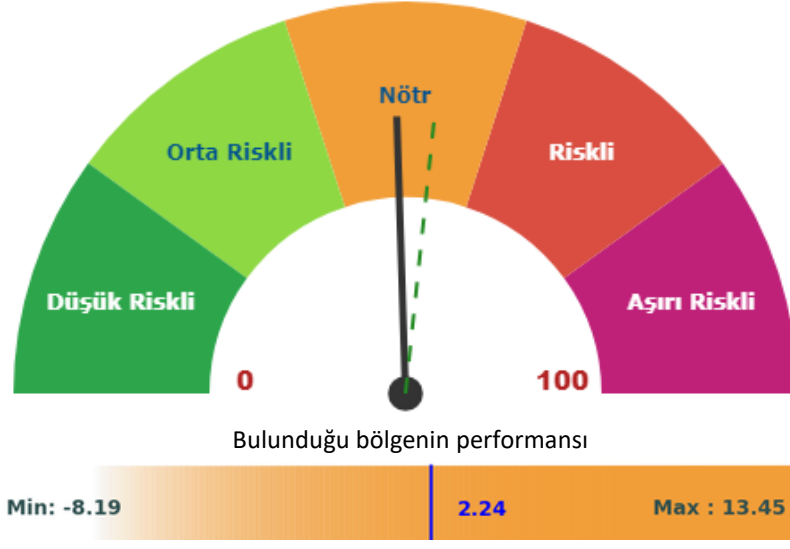


BIST30

BIST30 modeli bu hafta **nötr bölge** içinde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada BIST30 Endeksi yaklaşık **%3 değer kazanmıştır.** Model nötr bölgeye girdiğinden beri endeks getirisi **tarihsel ortalamasının üzerine ulaşmıştır.**

Bu hafta **49** Bir hafta önce **53** Bir ay önce **52**

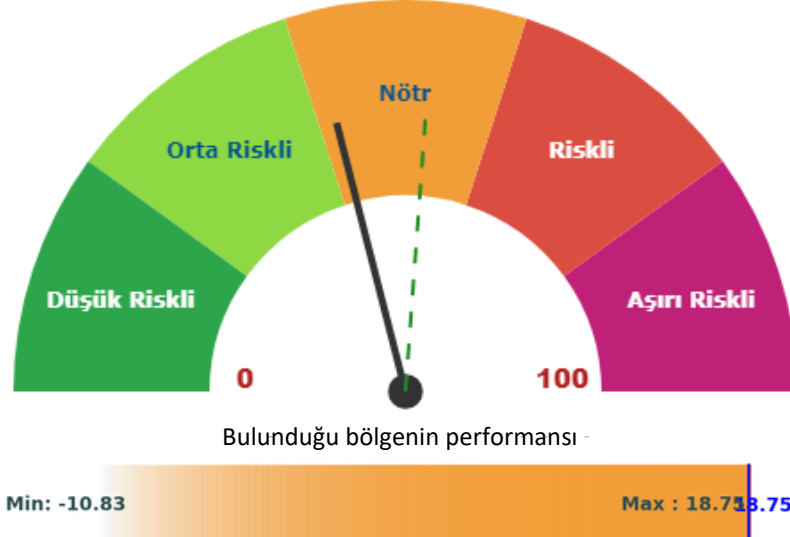


BIST BANKACILIK

BIST Bankacılık Endeksi modeli 1 haftalık ve 1 aylık dönemde **nötr bölge** içinde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda BIST Bankacılık Endeksi yaklaşık **%20 değer kazanmıştır.** Model nötr bölgeye girdiğinden beri endeks getirisi **tarihsel maksimum değerine ulaşmıştır.**

Bu hafta **42** Bir hafta önce **52** Bir ay önce **56**

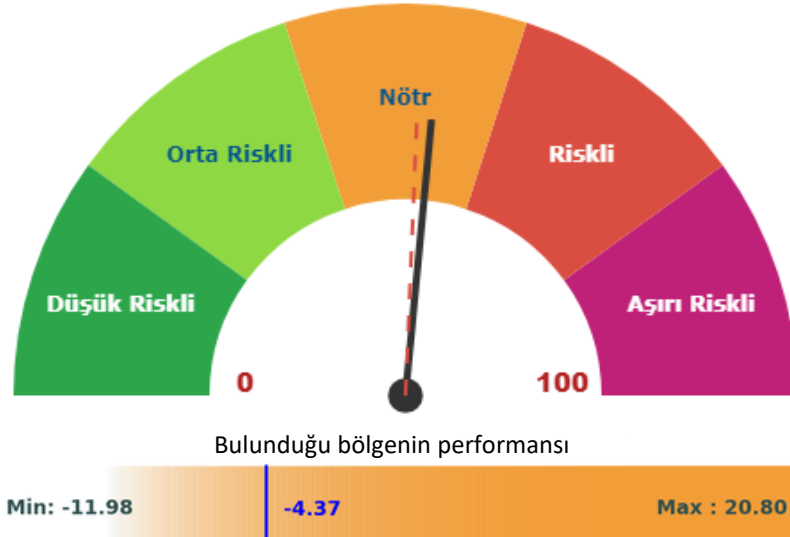


BIST SINAI

BIST Sınai Endeksi modeli 1 aylık ve 1 haftalık dönemde **nötr bölge** içinde riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftada BIST Sınai Endeksi yaklaşık **%3.5**, 1 ayda ise yaklaşık **%7 değer kaybı** yaşamıştır. Modelin nötr **bölgede bulunduğu süre tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır.**

Bu hafta **53** Bir hafta önce **51** Bir ay önce **47**

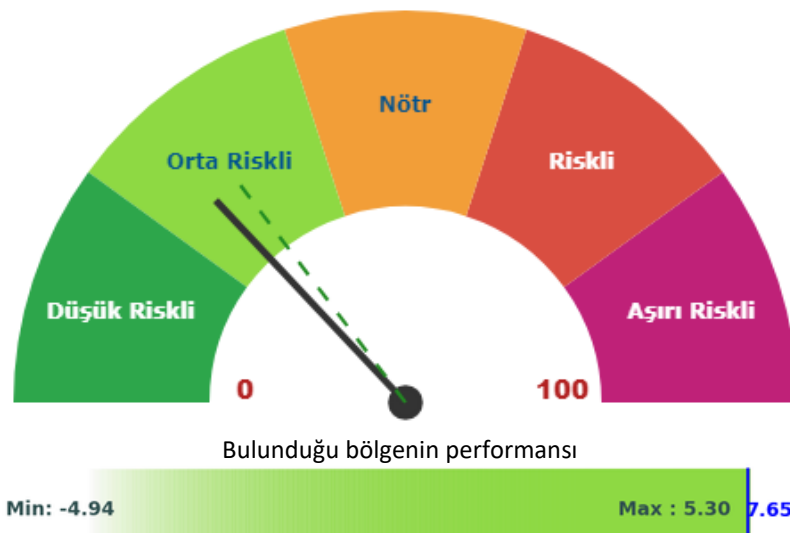


ALTIN

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

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda altın fiyatları **%5 değer kazanmıştır.** Model getirisi bulunduğu bölgenin **tarihsel maksimum değerinin üzerine ulaşmıştır.**

Bu hafta **26** Bir hafta önce **29** Bir ay önce **32**



# RİSKOMETRE

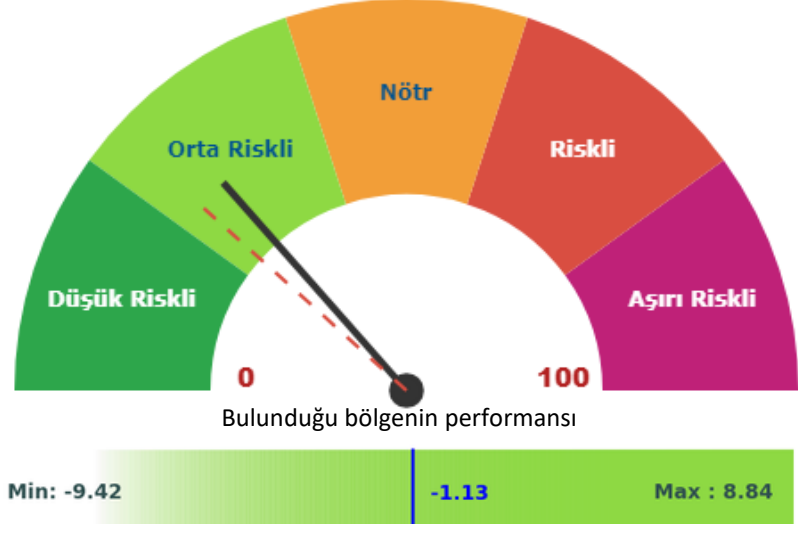
S&P

8 - 14 Nisan 2024

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

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftada S&P Endeksi yaklaşık **%2 değer kaybı yaşamıştır**. Model son 3 günde riskli yöne hızla ilerlemektedir.

Bu hafta **27** Bir hafta önce **23** Bir ay önce **33**

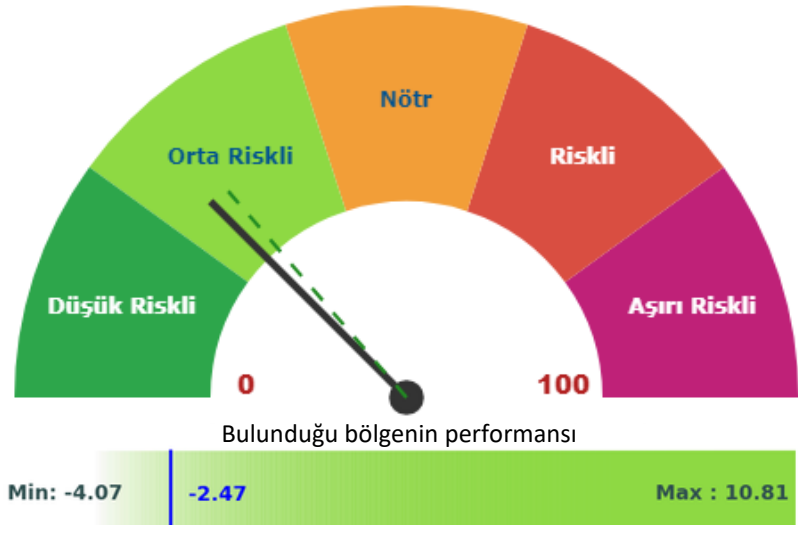


## NASDAQ

NASDAQ modeli bu hafta **orta risk** sinyali vermeye devam etmektedir.

Model bu hafta düşük riskli yöne doğru hareket ederek düşük risk bölgesini test etmesine rağmen burada kalıcı olamamıştır.

Bu hafta **25** Bir hafta önce **27** Bir ay önce **37**

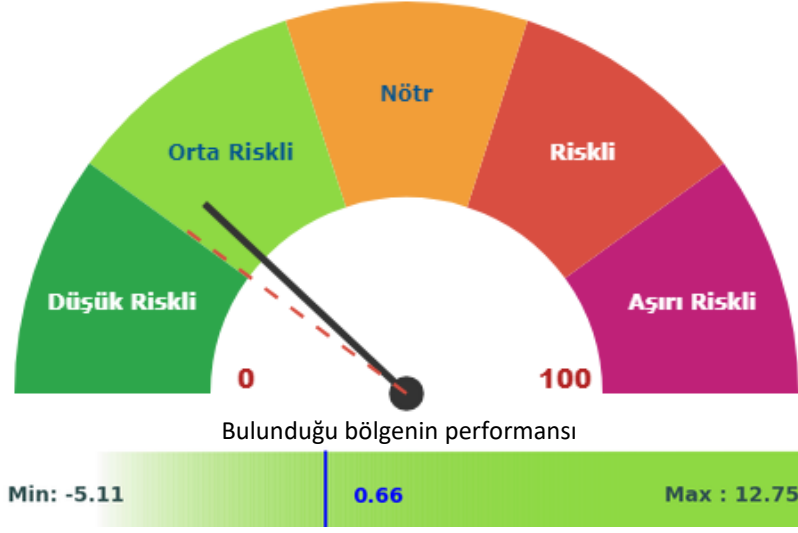


## DAX

Geçtiğimiz hafta düşük risk sinyali veren Almanya Hisse Senedi modeli bu hafta **orta riskli bölgeye** dönüş yapmıştır.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftada DAX Endeksi yaklaşık **%2 değer kaybetmiştir**. Bulunduğu nokta itibarı ile potansiyel getirisinin altında kalmıştır.

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

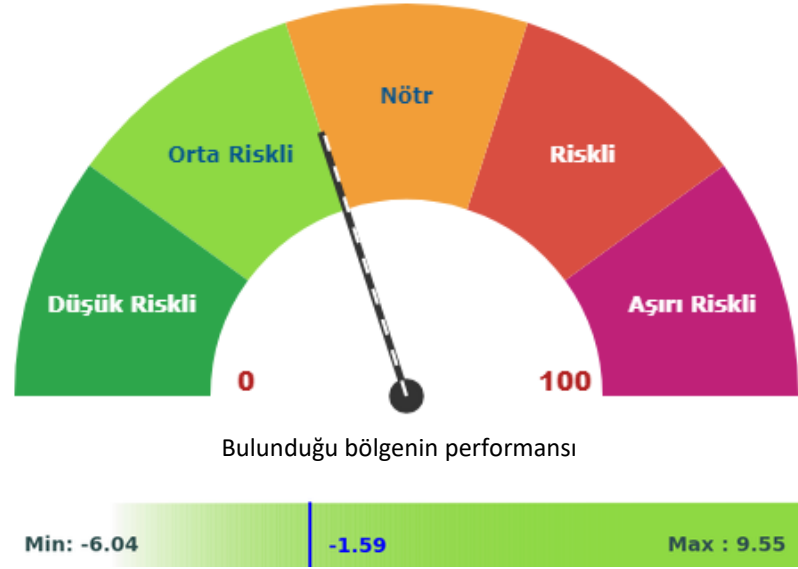


## NIKKEI

Japonya Hisse Senedi modeli bu hafta **orta riskli bölge** sınırında sabit kalmıştır.

Model orta risk sinyali verirken Nikkei Endeksi 1 haftada yaklaşık **%3.5 değer kaybetmiştir**. Endeks getirisi bu bölgedeki tarihsel ortalamasının altında seyretmektedir.

Bu hafta **40** Bir hafta önce **40** Bir ay önce **44**

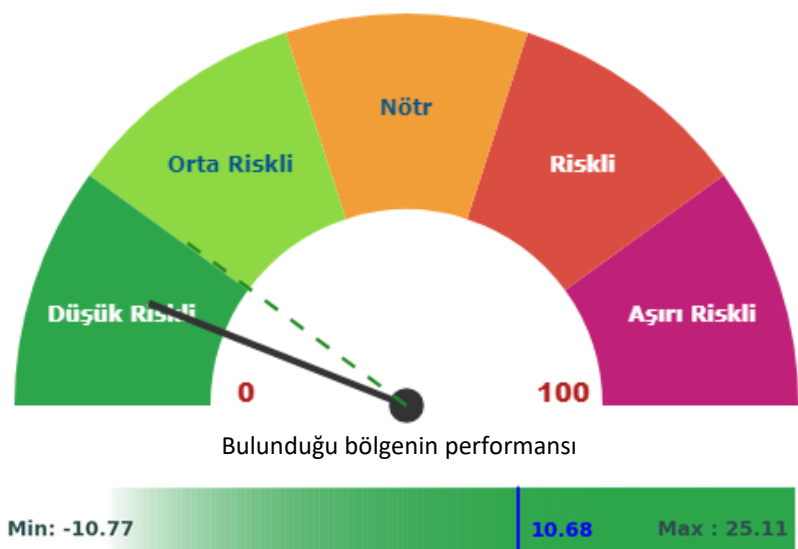


## PETROL

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

Petrol fiyatları son 1 ayda yaklaşık **%11 değer kazanmıştır**. Bulunduğu yer itibarıyla bu **bölgenin ortalama getirisinin %9 altında kalmıştır**.

Bu hafta **12** Bir hafta önce **20** Bir ay önce **45**



# RİSKOMETRE

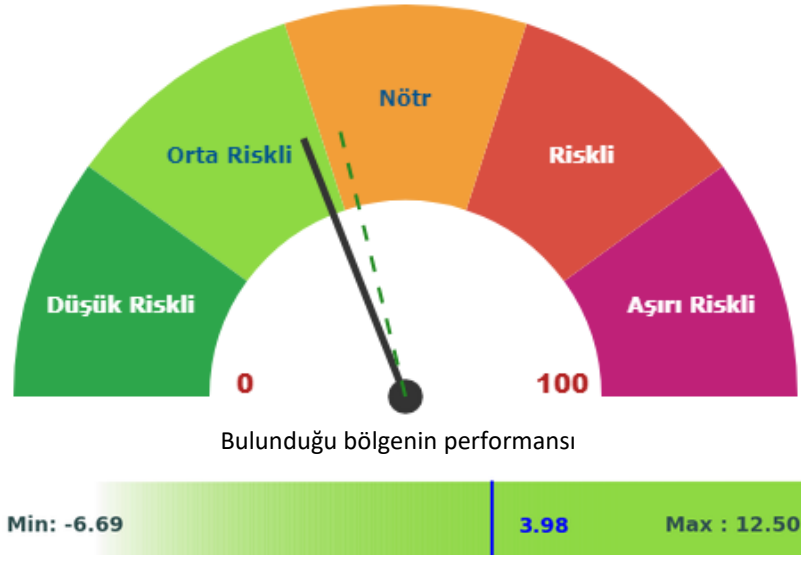
## GÜMÜŞ

8 - 14 Nisan 2024

Geçtiğimiz hafta nötr risk sinyali veren Gümüş modeli hafta başında **orta riskli bölgeye** dönüş yapmıştır.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada Gümüş fiyatları yaklaşık **%7 değer kazanırken** bölgeye girdiğinden beri getirisi tarihsel ortalamasının üzerine ulaşmıştır.

Bu hafta **32** Bir hafta önce **42** Bir ay önce **38**

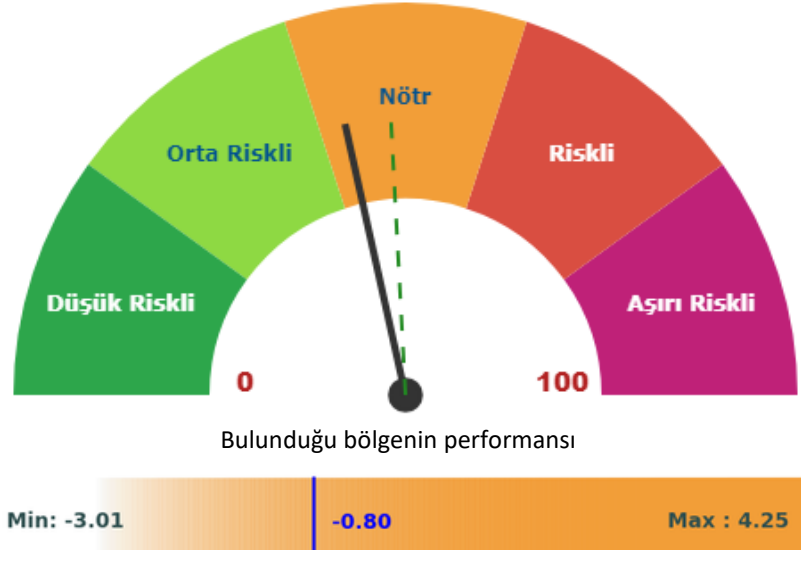


## GBPUSD

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

Modelin nötr sinyal verdiği 1 aylık dönemde GBPUSD paritesi yaklaşık **%2 değer kaybederken**, nötr bölge içindeki ortalama getirisine yakın seviyelerde bulunmaktadır.

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

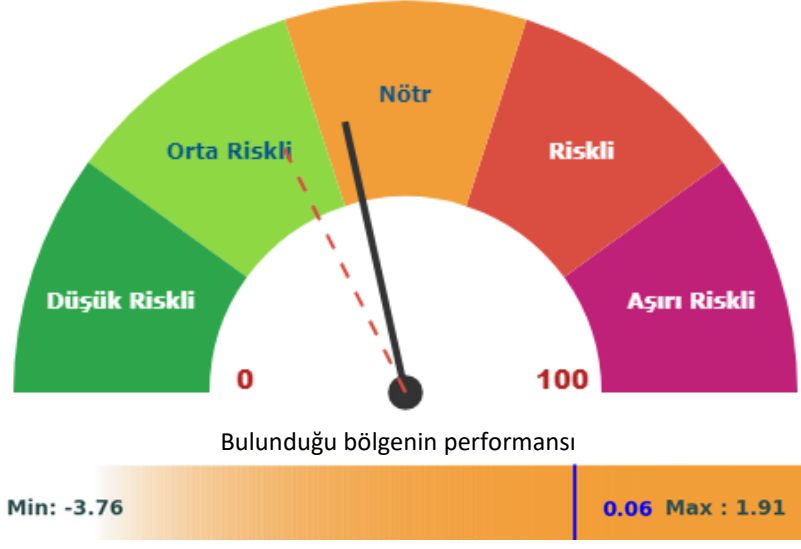


## EURUSD

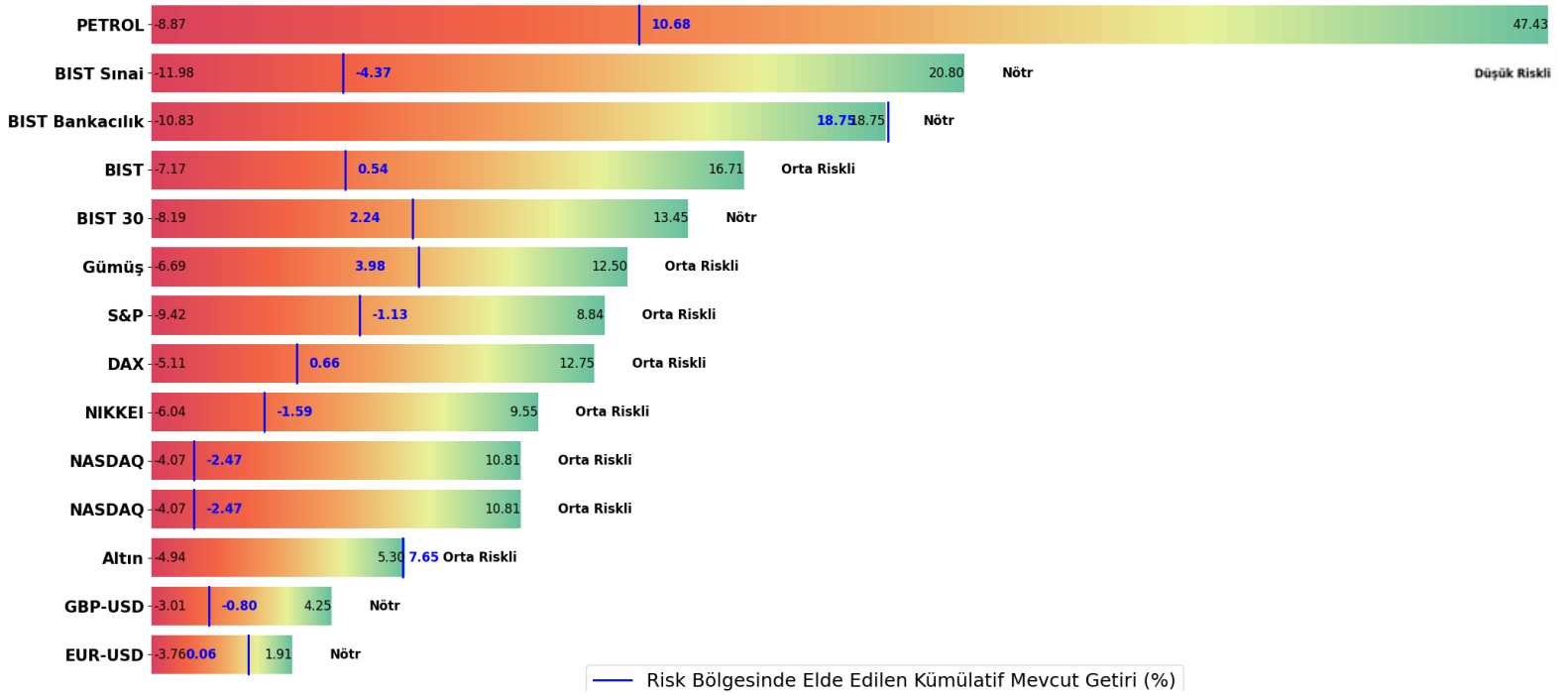
EURUSD modeli orta riskli bölgeden **nötr bölgeye** geçiş yapmıştır.

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

Bu hafta **43** Bir hafta önce **35** Bir ay önce **30**

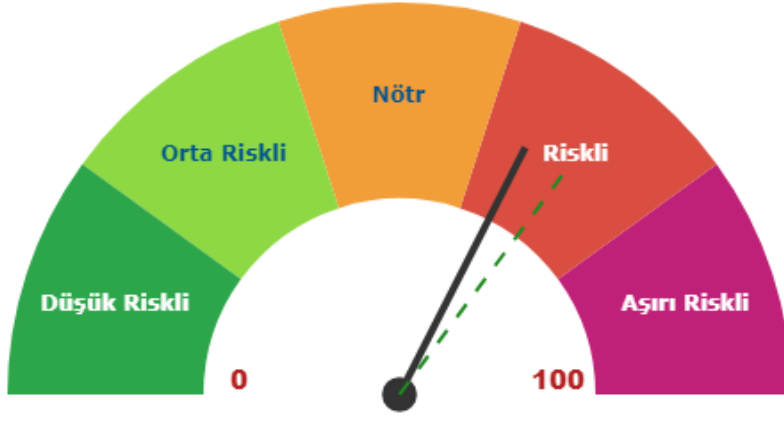


## Bulunduğu Bölgeye Göre Getiri Bantları



\*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](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 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.”