

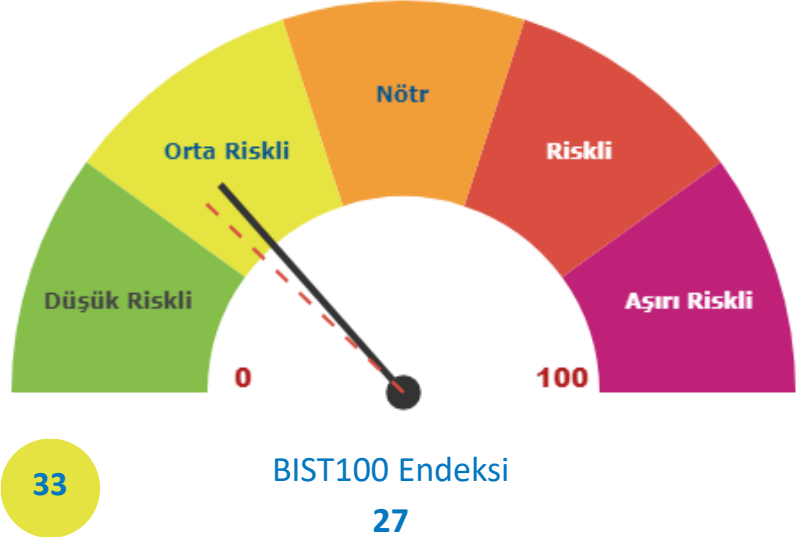
RİSKOMETRE

BIST100

25 - 31 Aralık 2023

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

Modelin oynak bir dönem geçirdiği 1 ayda BIST100 Endeksinde yaklaşık **%2.5**, riskli yöne ilerlediği bu hafta ise yaklaşık **%3 değer kaybı** gözlenmiştir.

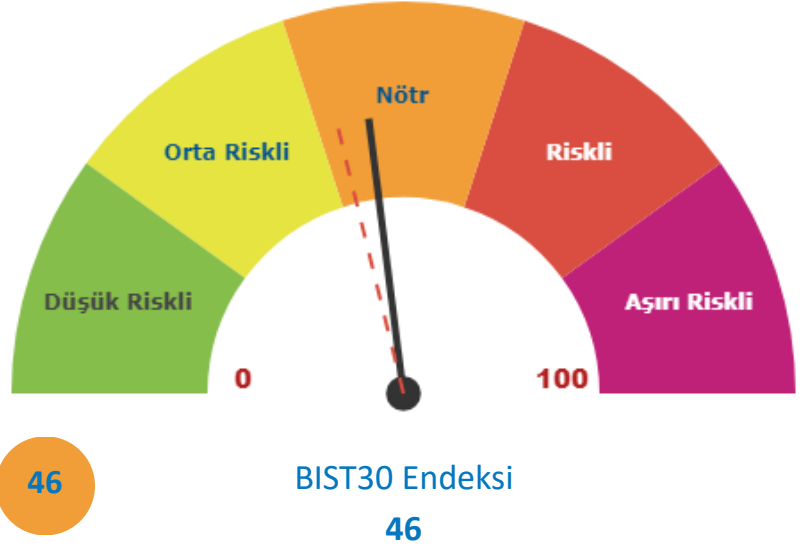


Bu hafta **27** Bir hafta önce **24** Bir ay önce **33**

BIST30

Bu hafta nötr bölge içinde riskli yöne ilerleyen BIST30 modeli 1 ay önce bulunduğu konuma dönüş yapmıştır.

Modelin riskli yönde ilerlediği 1 haftalık dönemde BIST30 Endeksi yaklaşık **%2.5 değer kaybı** yaşamıştır.

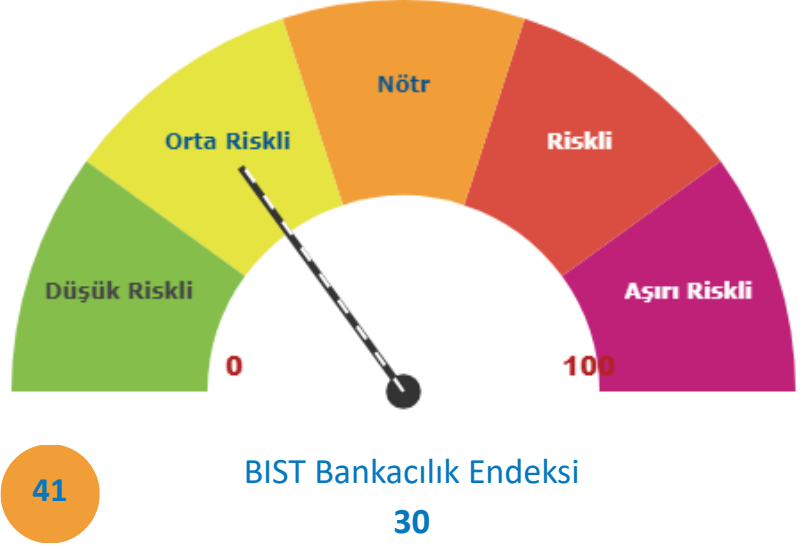


Bu hafta **46** Bir hafta önce **42** Bir ay önce **46**

BIST BANKACILIK

BIST Bankacılık modeli bu hafta, 1 ay önce geçiş yaptığı **orta riskli** bölge içinde stabil seyrini korumuştur.

Model 1 aylık dönemde nötr bölgeden orta riskli bölgeye geçerken BIST Bankacılık Endeksi yaklaşık **%15 değer kazanmıştır**.

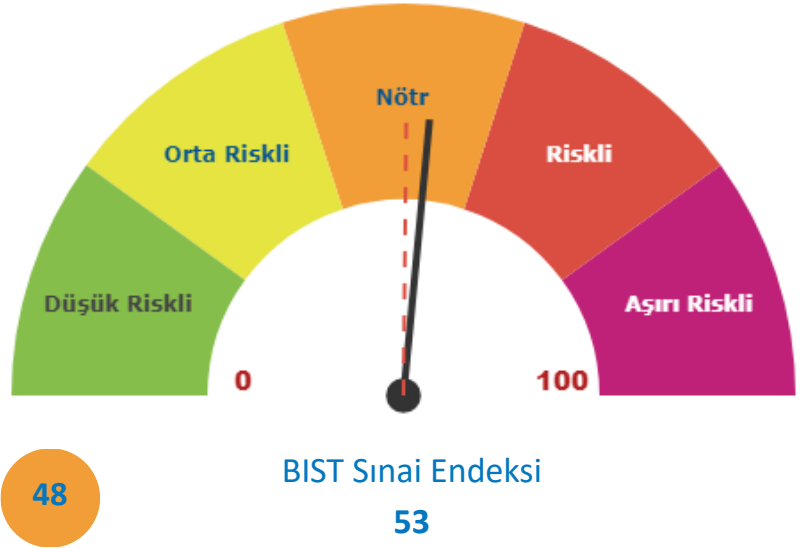


Bu hafta **30** Bir hafta önce **30** Bir ay önce **41**

BIST SINAI

BIST Sınai Endeksi modeli 1 hafta ve 1 ayda **nötr** bölge içinde riskli yöne ilerlemiştir.

Model riskli yöne ilerlerken BIST Sınai Endeksinde 1 haftada yaklaşık **%4**, 1 ayda ise yaklaşık **%7 değer kaybı** gözlenmiştir.

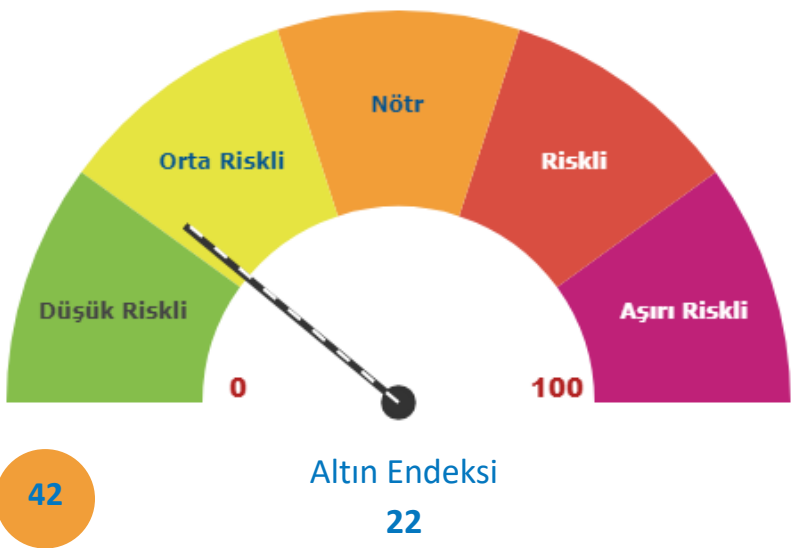


Bu hafta **53** Bir hafta önce **50** Bir ay önce **48**

ALTIN

Altın modeli 1 ayda düşük riskli yöne ilerleyerek nötr bölgeden **orta riskli** bölgeye geçiş yapmış, bu hafta ise konumunu korumuştur.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda Altın fiyatları yaklaşık **%2.5 değer kazanmıştır**.



Bu hafta **22** Bir hafta önce **22** Bir ay önce **42**

RİSKOMETRE

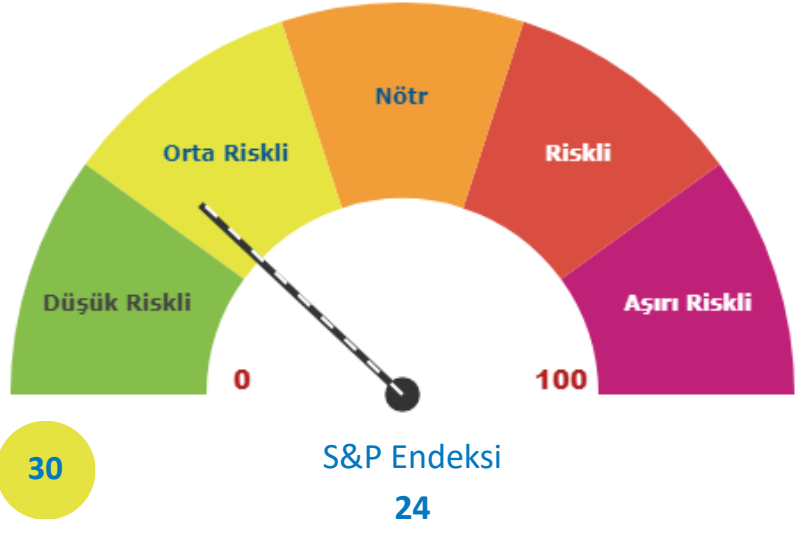
S&P

25 - 31 Aralık 2023

ABD Hisse Senedi modeli 1 ayda **orta riskli** bölge içinde düşük riskli yöne ilerlerken bu hafta stabil kalmıştır.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 aylık dönemde S&P Endeksinde yaklaşık **%4 getiri gözlenmiştir.**

Bu hafta **24** Bir hafta önce **24** Bir ay önce **30**

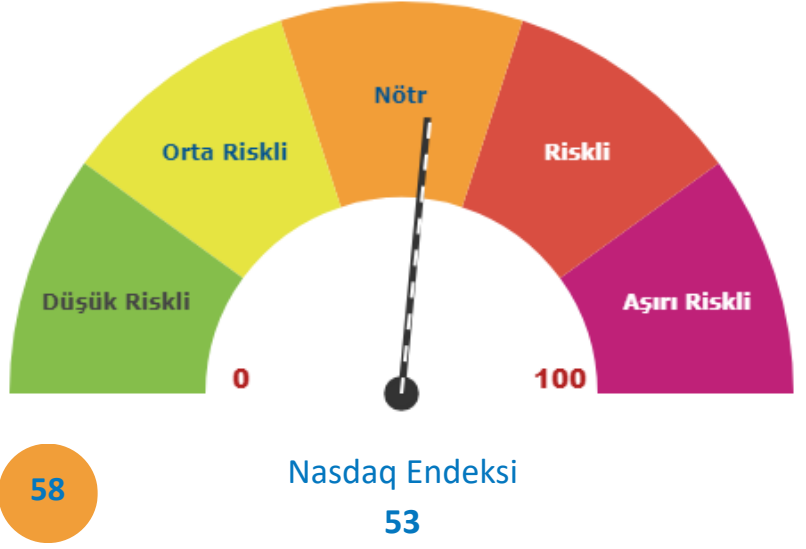


NASDAQ

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

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 aylık dönemde NASDAQ Endeksi yaklaşık **%5 değer kazanmıştır.**

Bu hafta **53** Bir hafta önce **53** Bir ay önce **58**

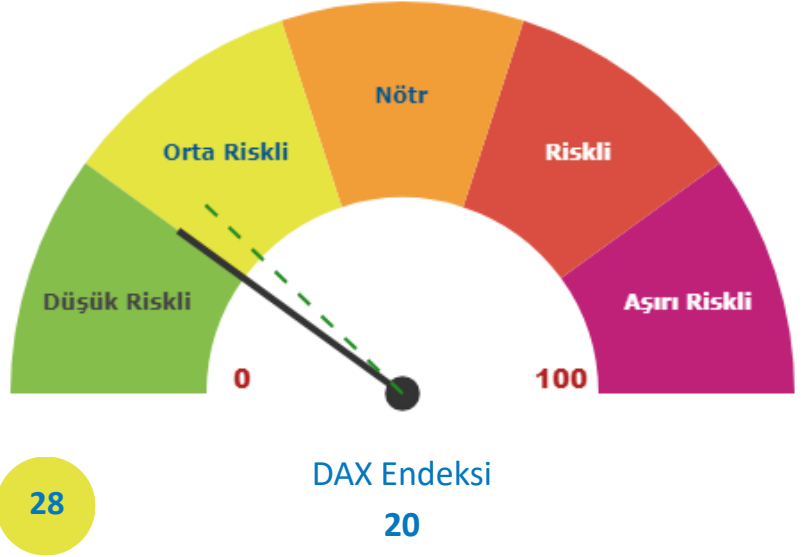


DAX

Almanya Hisse Senedi modeli 1 ayda orta riskli bölgede yer alırken bu hafta **düşük riskli** bölge sınırına geçiş yapmıştır.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 aylık dönemde DAX Endeksinde yaklaşık **%4.5 getiri** gözlenmiş, 1 haftada ise yatay seyretmiştir.

Bu hafta **20** Bir hafta önce **24** Bir ay önce **28**

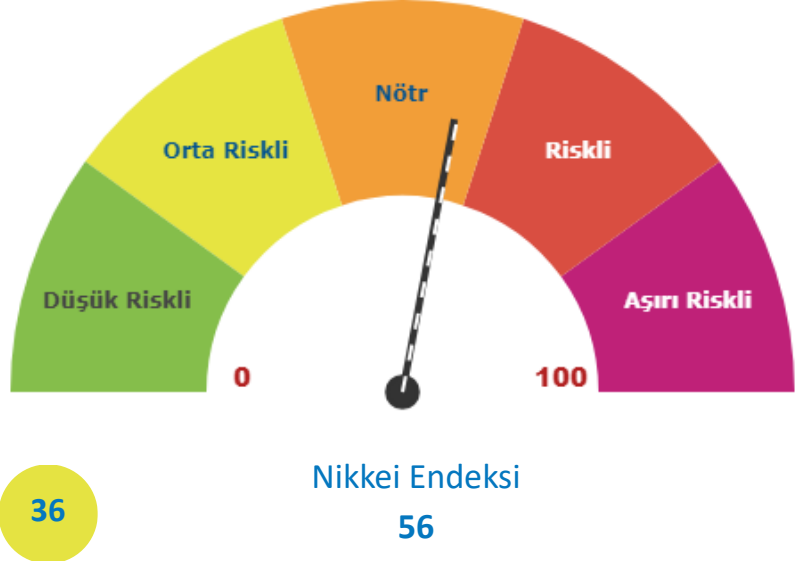


NIKKEI

1 aylık dönemde orta riskli bölgeden **nötr** bölgeye geçiş yapan Japonya Hisse Senedi modeli bu hafta konumunu korumuştur.

Model 1 ayda riskli yönde ilerlerken Nikkei Endeksinde yaklaşık **%1.5 değer kaybı** gözlenmiştir.

Bu hafta **56** Bir hafta önce **56** Bir ay önce **36**

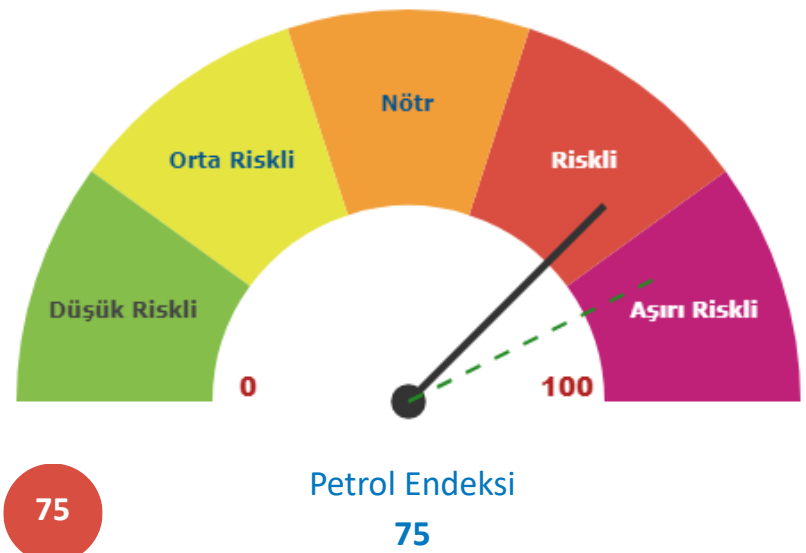


PETROL

Petrol modeli bu hafta düşük riskli yöne ilerleyerek geçen hafta test ettiği aşırı riskli bölgeden **riskli** bölgeye dönüş yapmıştır.

Model 1 ay önceki konumuna dönerken düşük riskli yöne ilerlediği bu hafta Petrol fiyatları yaklaşık **%4 değer kazanmıştır.**

Bu hafta **75** Bir hafta önce **85** Bir ay önce **75**



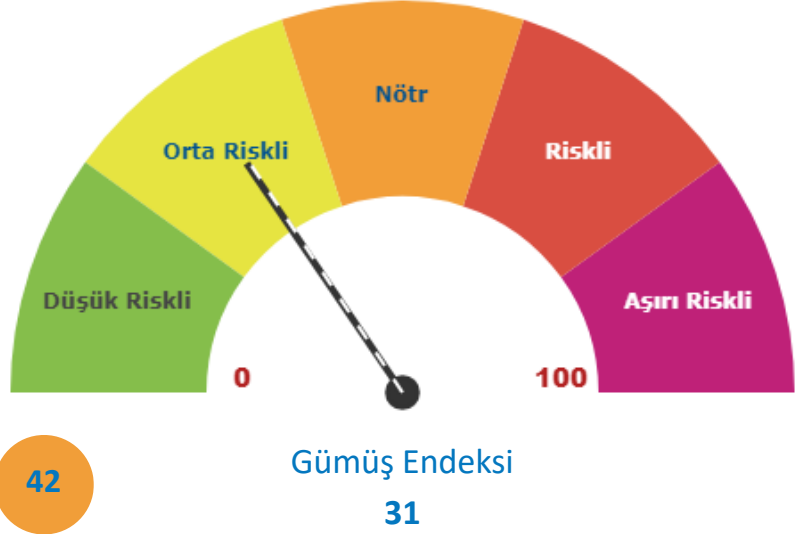
RİSKOMETRE

GÜMÜŞ

25 - 31 Aralık 2023

Gümüş modeli 1 ayda nötr bölgeden **orta riskli** bölgeye geçiş yapmış ve bu hafta da konumunu korumuştur.

Modelin stabil seyrettiği bu hafta Gümüş fiyatları yaklaşık **%2.5**, düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda ise yaklaşık **%3.5 değer** kazanmıştır.

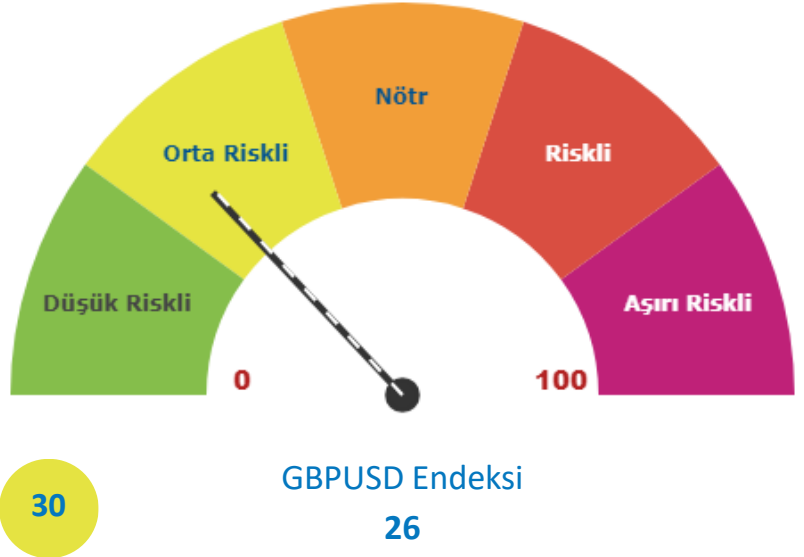


Bu hafta **31** Bir hafta önce **31** Bir ay önce **42**

GBPUSD

GBPUSD modeli 1 aylık ve 1 haftalık dönemde **orta riskli** bölge içinde yer almaya devam ediyor.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda GBPUSD paritesi yaklaşık **%1 değer** kazanmıştır.

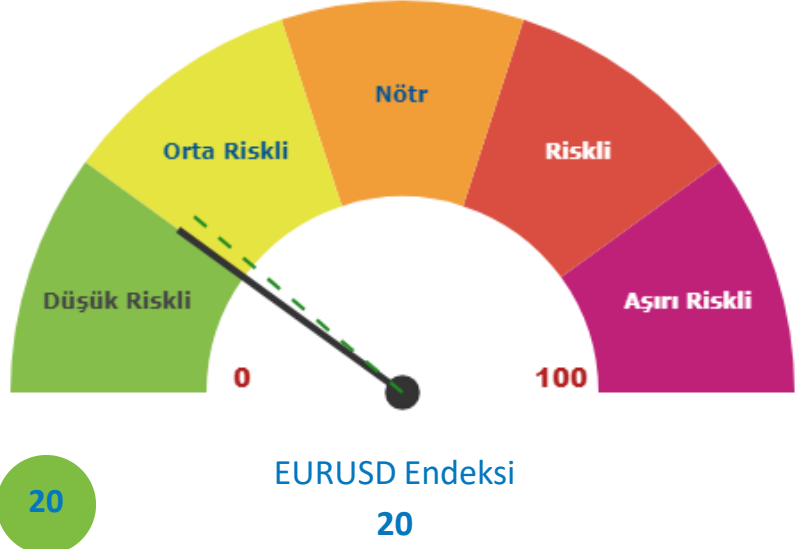


Bu hafta **26** Bir hafta önce **26** Bir ay önce **30**

EURUSD

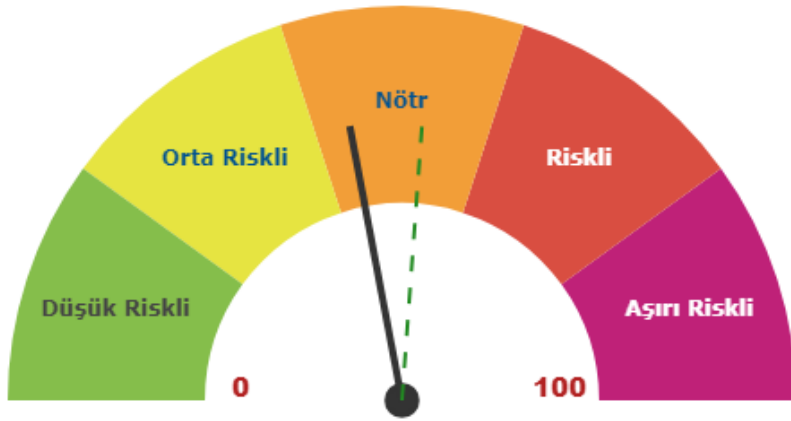
Geçtiğimiz hafta **orta riskli** bölgeyi test eden EURUSD modeli bu hafta düşük riskli bölge sınırına dönüş yapmıştır.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada EURUSD paritesi yaklaşık **%1 değer** kazanmıştır.



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

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."