

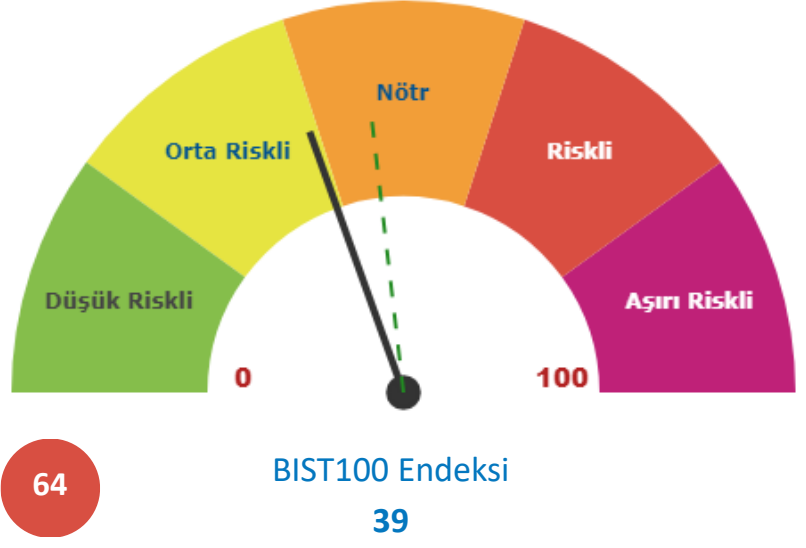
# RİSKOMETRE

## BIST100

27 Kasım - 3 Aralık 2023

BIST100 modeli 3 haftadır dengede bulunduğu nötr bölgeden **orta riskli** bölgeye geçiş yapmıştır.

Modelin 1 haftalık düşük riskli yöndeki hareketi ile aynı dönemde BIST100 Endeksinde yaklaşık **%1.5**, 1 ayda ise **%3** getiri gözlenmiştir.

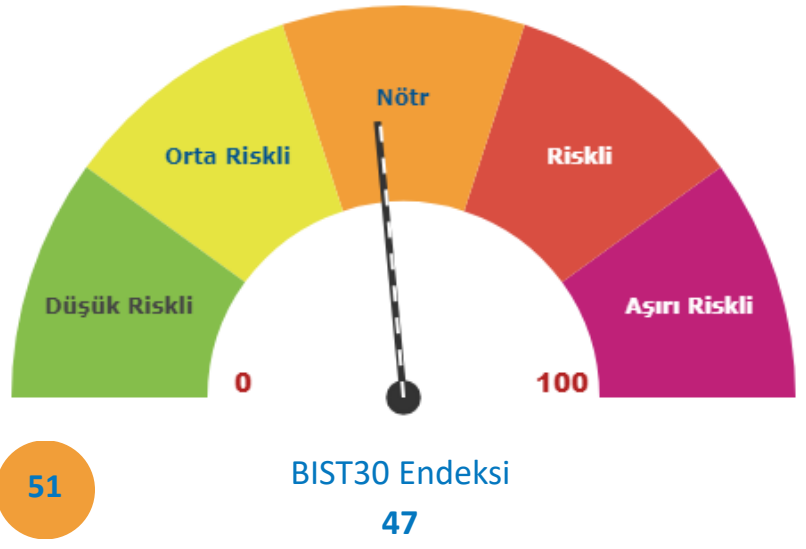


Bu hafta **39** Bir hafta önce **46** Bir ay önce **64**

## BIST30

BIST30 Modeli kısa ve uzun vadede **nötr** bölgede yer almaya devam etmektedir.

Modelin düşük riskli yönde ilerlediği 1 aylık dönemde BIST30 Endeksi yaklaşık **%5.5** getiri sağlamıştır.

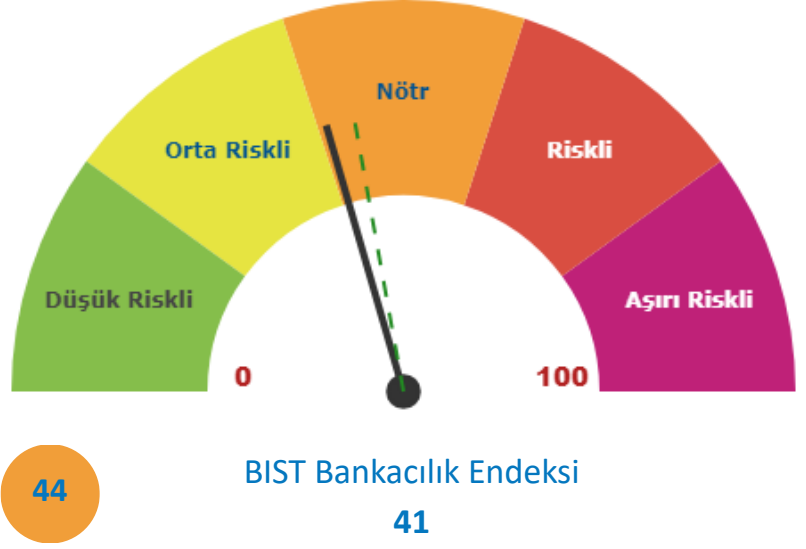


Bu hafta **47** Bir hafta önce **47** Bir ay önce **51**

## BIST BANKACILIK

**Nötr** bölge içinde yer alan BIST Bankacılık modeli bulunduğu bölgeyi koruyarak orta riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin 1 haftalık bu hareketi ile aynı dönemde BIST Bankacılık Endeksi yaklaşık **%1.5** değer kazanmıştır.

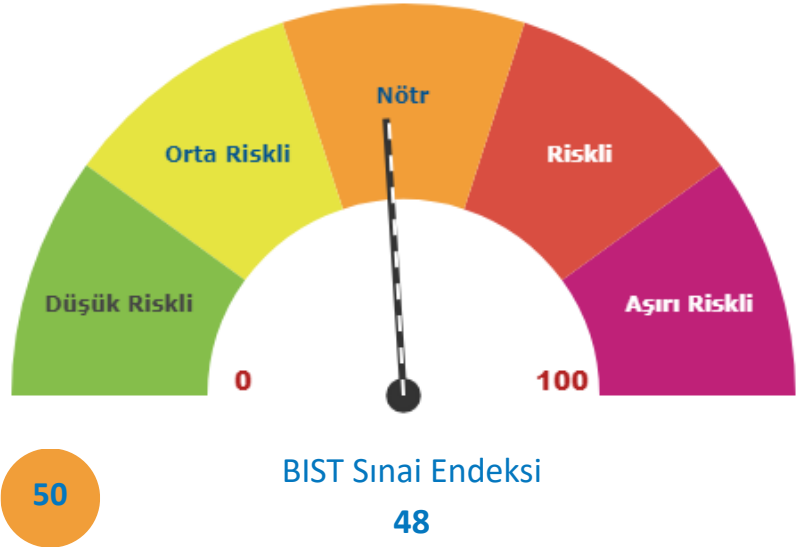


Bu hafta **41** Bir hafta önce **44** Bir ay önce **44**

## BIST SINAI

BIST Sınai Endeksi 1 ay önce geçiş yaptığı **nötr** bölge içinde düşük riskli yöne ilerlerken, bu hafta konumunu korumaktadır.

Modelin 1 aylık düşük riskli yönde hareketi ile aynı dönemde BIST Sınai Endeksinde yaklaşık **%4** getiri gözlenmiştir.

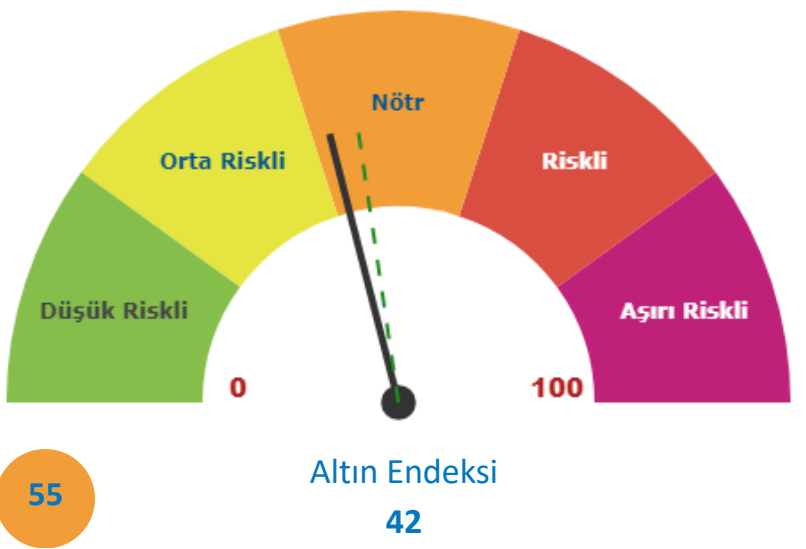


Bu hafta **48** Bir hafta önce **48** Bir ay önce **50**

## ALTIN

Altın modeli hareketli geçirdiği 1 aylık dönemde **nötr** bölge içinde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Altın fiyatları 1 ayda yaklaşık **%1** getiri sağlamış, 1 haftada ise stabil kalmıştır.



Bu hafta **42** Bir hafta önce **45** Bir ay önce **55**

# RİSKOMETRE

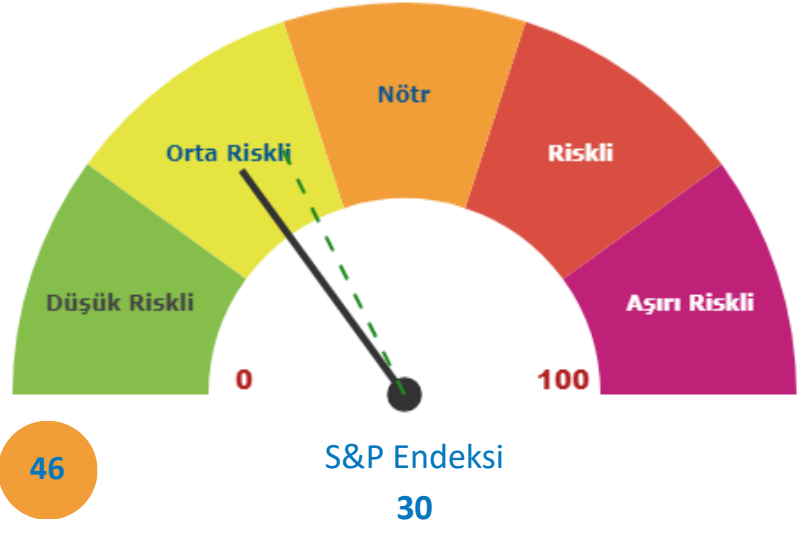
S&P

27 Kasım - 3 Aralık 2023

ABD Hisse Senedi modeli geçen hafta geçiş yaptığı **orta riskli** bölge içinde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Model düşük riskli yönde ilerlerken S&P Endeksinde 1 haftada yaklaşık %1, 1 aylık bölge değişimi sırasında ise yaklaşık %11 **getiri gözlenmiştir**.

Bu hafta **30** Bir hafta önce **34** Bir ay önce **46**

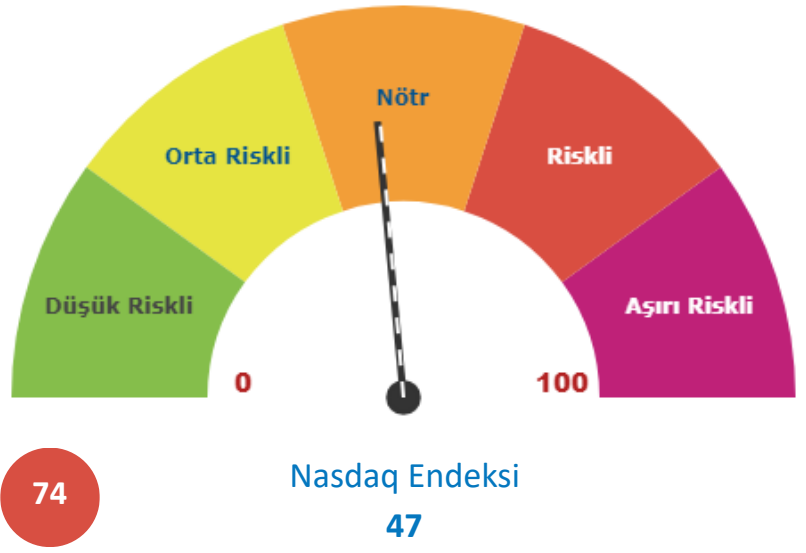


## NASDAQ

NASDAQ Modeli geçen hafta bulunduğu riskli bölgeden **nötr** bölgeye geçiş yapmış ve bu hafta konumunu korumuştur.

Modelin 1 aylık dönemde bölge değişimi esnasında NASDAQ Endeksi yaklaşık %13 **getiri sağlamıştır**.

Bu hafta **47** Bir hafta önce **47** Bir ay önce **74**

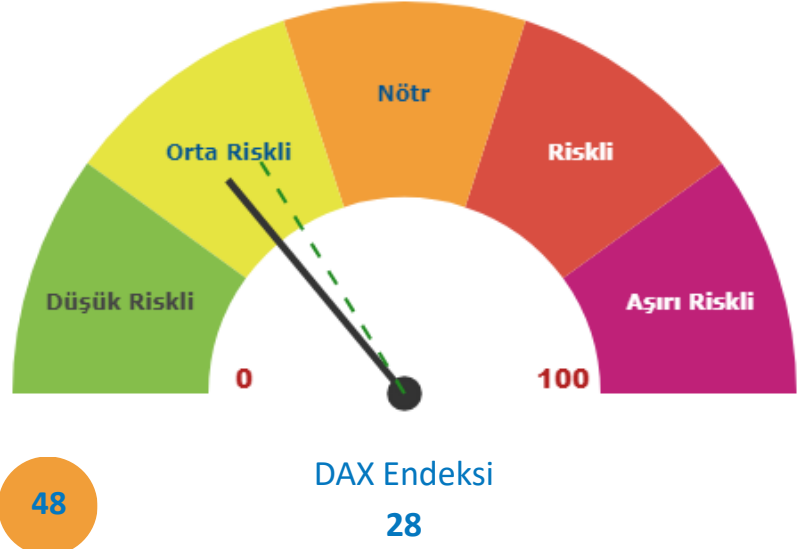


## DAX

Almanya Hisse Senedi modeli geçtiğimiz hafta geçiş yaptığı **orta riskli** bölge içinde düşük riskli yönde ilerleyişini sürdürmektedir.

Modelin düşük riskli yönde hareketi ile 1 haftada DAX Endeksinde yaklaşık %1, 1 ayda ise yaklaşık %9 **getiri gözlenmiştir**.

Bu hafta **28** Bir hafta önce **32** Bir ay önce **48**

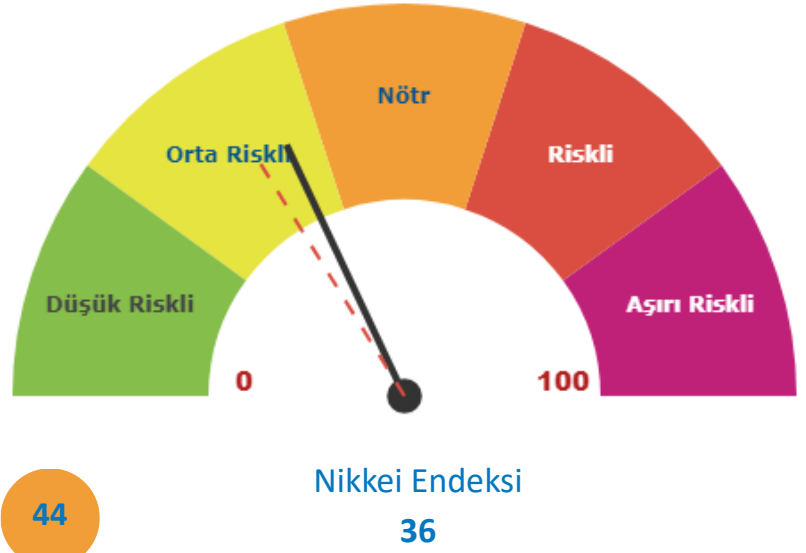


## NIKKEI

1 ay önce nötr bölgede bulunan Japonya Hisse Senedi Modeli bu hafta bulunduğu **orta riskli** bölge içinde riskli yöne ilerlemiştir.

Model 1 haftada oynak bir hareket sergilerken getirisi stabil kalmış, 1 ayda ise yaklaşık %8.5 **getiri sağlamıştır**.

Bu hafta **36** Bir hafta önce **32** Bir ay önce **44**

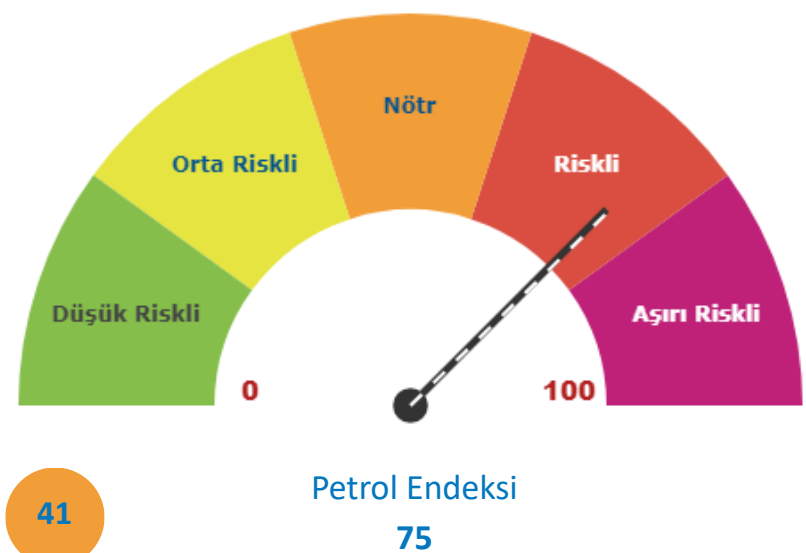


## PETROL

Petrol modeli 1 ayda nötr bölgeden **riskli** bölgeye geçmiş ve bu hafta da konumunu korumuştur.

Modelin 1 aylık bölge değişimi esnasında petrol fiyatları yaklaşık %10 **değer kaybetmiştir**.

Bu hafta **75** Bir hafta önce **75** Bir ay önce **41**



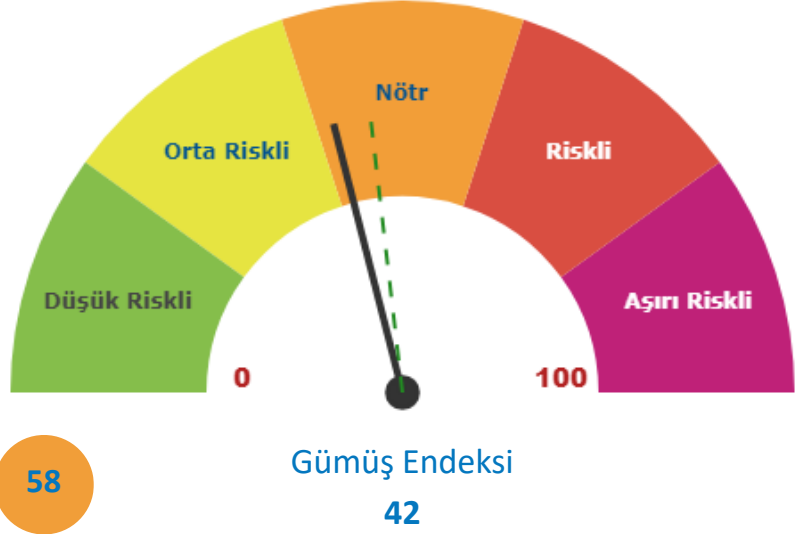
# RİSKOMETRE

## GÜMÜŞ

27 Kasım - 3 Aralık 2023

Gümüş Modeli bu hafta bulunduğu **nötr** bölge içinde dalgalı hareket sergilerken 1 ayda riskli bölge sınırından orta riskli bölge sınırına yaklaşmıştır.

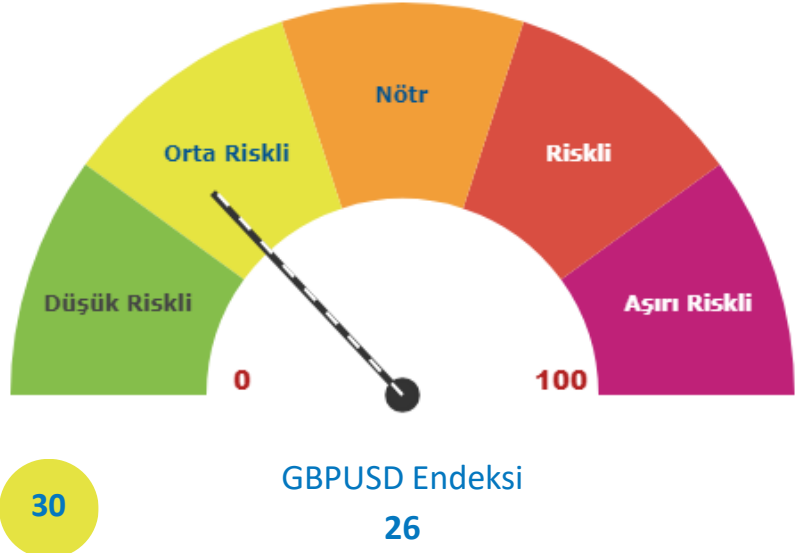
Model düşük riskli yönde ilerlerken Gümüş fiyatları 1 haftada yaklaşık %1, 1 ayda ise yaklaşık %2.5 değer kazanmıştır.



## GBPUSD

GBPUSD modeli 1 aylık dönemde bulunduğu **orta riskli** bölge içinde düşük riskli yöne ilerlerken, 1 haftada stabil kalmıştır.

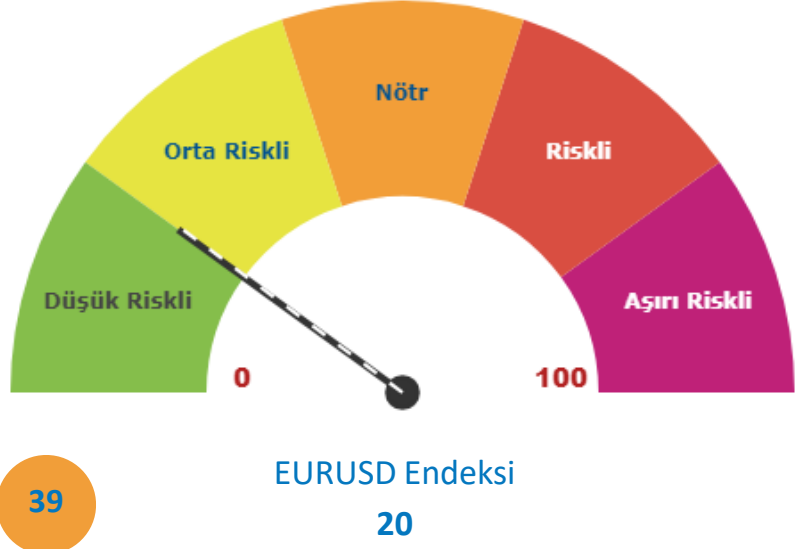
GBPUSD paritesi 1 ayda yaklaşık %3.5 değer kazanmıştır.



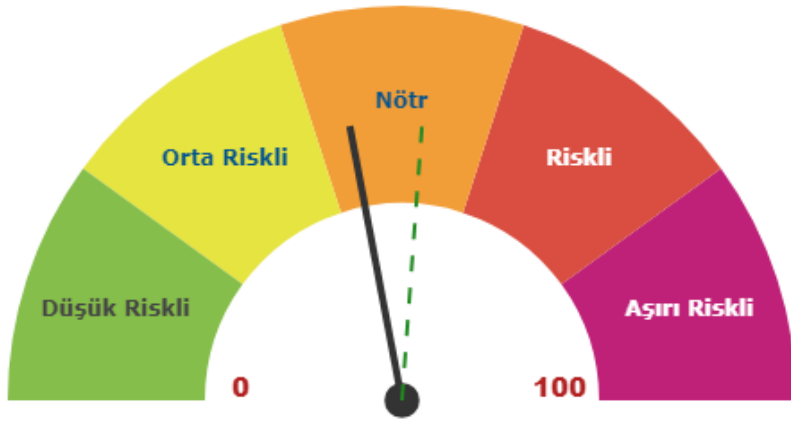
## EURUSD

EURUSD modeli 1 ay önce bulunduğu nötr bölgeden **düşük riskli** bölge sınırına geçiş yapmış ve bu hafta stabil konumunu korumuştur.

Modelin 1 aylık düşük riskli yönde hareketi sırasında EURUSD paritesi yaklaşık %3.5 getiri sağlamıştır.



## 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."