

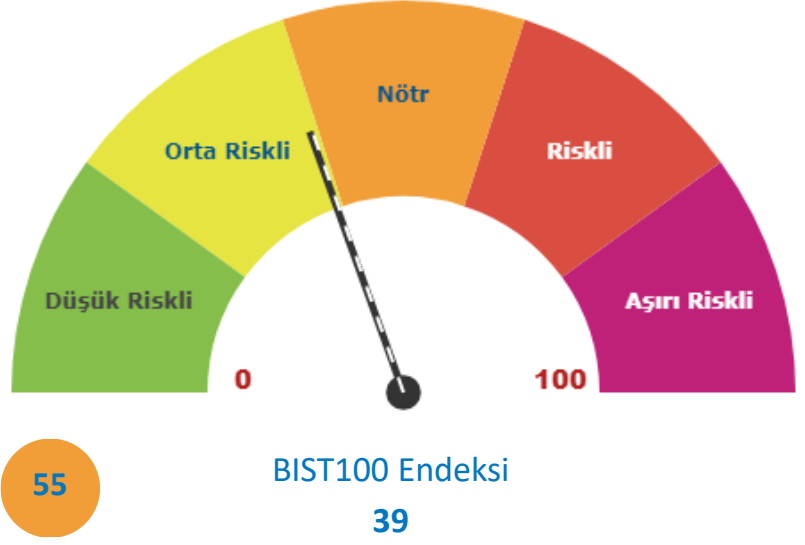
# RİSKOMETRE

## BIST100

4 - 11 Aralık 2023

BIST100 modeli geçen hafta geçiş yaptığı **orta riskli** bölgede konumunu korumaktadır.

Modelin orta riskli bölgede oynak hareket sergilediği 1 haftada BIST100 Endeksinde yaklaşık **%1**, 1 ayda ise yaklaşık **%7.5** getiri gözlenmiştir.

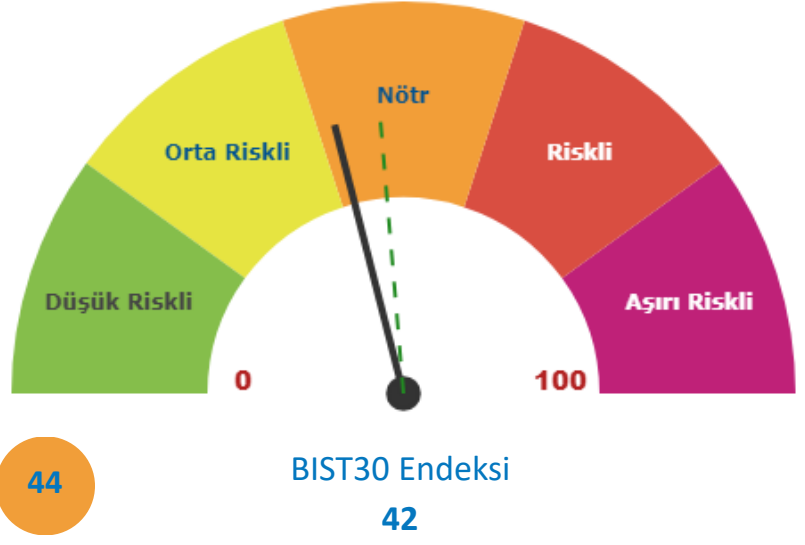


Bu hafta **39** Bir hafta önce **39** Bir ay önce **55**

## BIST30

BIST30 modeli 1 aylık dönemde **nötr bölge** içinde yer alırken bu hafta düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada BIST30 Endeksi yaklaşık **%2.5**, 1 aylık dönemde ise **yaklaşık %11** getiri sağlamıştır.

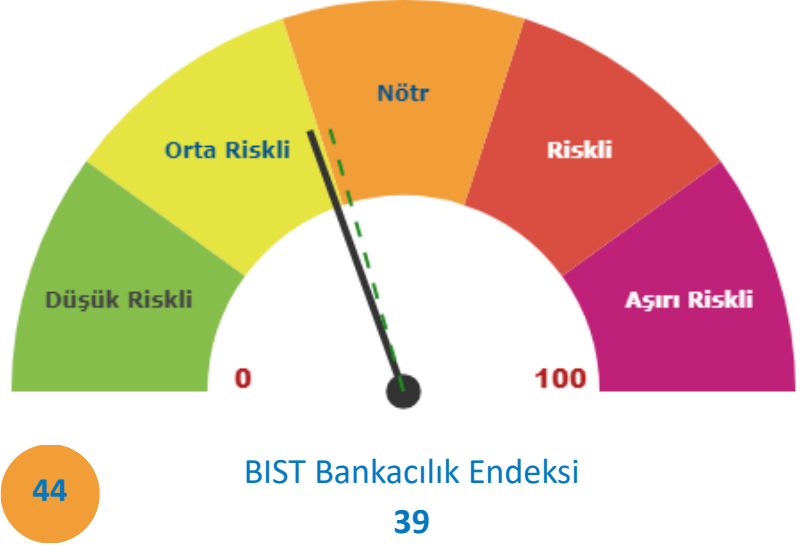


Bu hafta **42** Bir hafta önce **47** Bir ay önce **44**

## BIST BANKACILIK

Ekim ortasından beri nötr bölge içinde yer alan BIST Bankacılık modeli bu hafta **orta riskli** bölgeye geçiş yapmıştır.

Modelin 1 haftalık bu hareketi ile aynı dönemde BIST Bankacılık Endeksi yaklaşık **%7**, 1 ayda ise yaklaşık **%12** değer kazanmıştır.

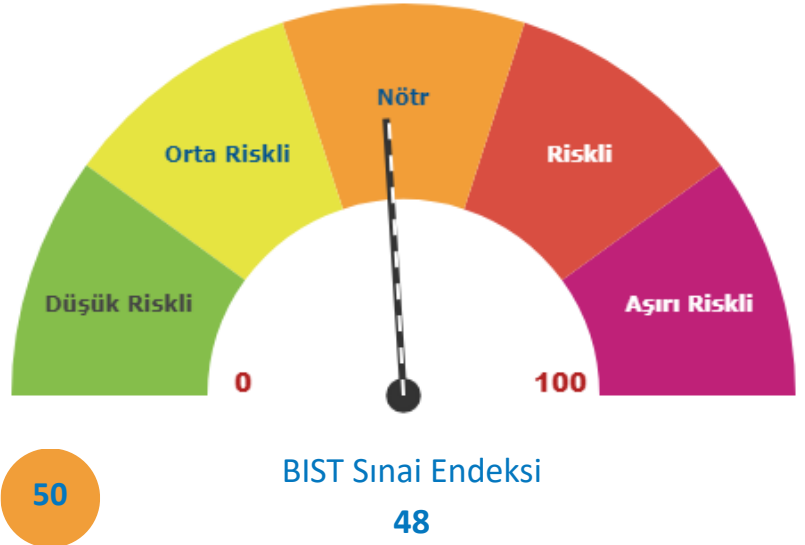


Bu hafta **39** Bir hafta önce **41** Bir ay önce **44**

## BIST SINAI

BIST Sınai Endeksi modeli bu hafta bulunduğu **nötr** bölge içinde konumunu korumaktadır.

Modelin 1 aylık düşük riskli yöndeki hareketi ile aynı dönemde BIST Sınai Endeksinde yaklaşık **%5.5** getiri gözlenmiştir.



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

## ALTIN

Altın modeli hareketli bir dönem geçirmeye devam ederken 1 aylık ve 1 haftalık dönemde düşük riskli yönde ilerleyerek **orta riskli** bölgeye geçiş yapmıştır.

Altın fiyatları 1 haftada yaklaşık **%2**, 1 ayda ise yaklaşık **%3** değer kazanmıştır.



Bu hafta **32** Bir hafta önce **42** Bir ay önce **52**

# RİSKOMETRE

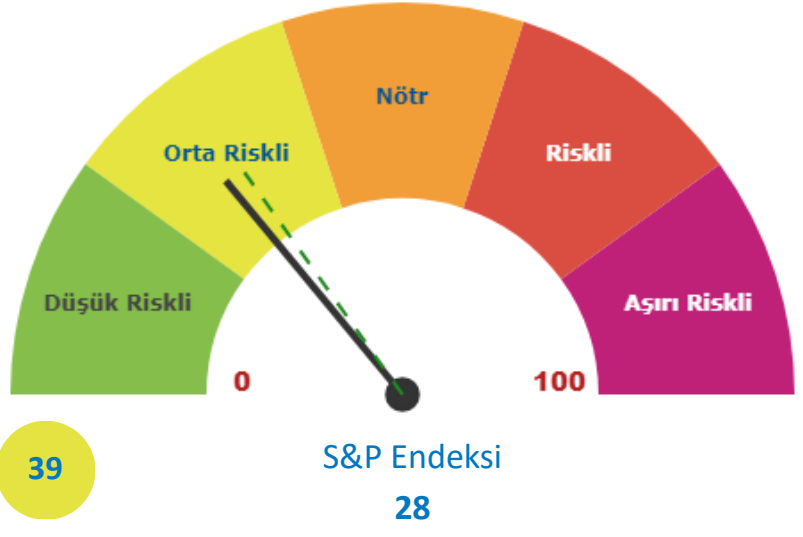
S&P

4 - 11 Aralık 2023

ABD Hisse Senedi modeli bulunduğu **orta riskli** bölge içinde düşük riskli yöne ilerlemeye devam etmektedir.

Model düşük riskli yönde ilerlerken S&P Endeksinde 1 ayda yaklaşık **%8.5 getiri gözlenmiştir**.

Bu hafta **28** Bir hafta önce **30** Bir ay önce **39**

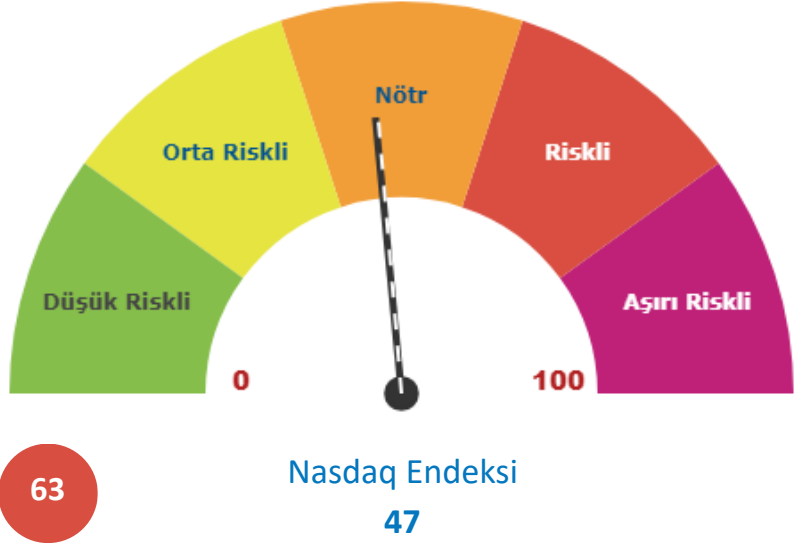


## NASDAQ

NASDAQ modeli geçen hafta geçiş yaptığı **nötr** bölge içinde konumunu korumaktadır.

Modelin 1 aylık dönemde riskli bölgeden nötr bölgeye geçişi ile aynı dönemde NASDAQ Endeksi yaklaşık **%11 getiri sağlamıştır**.

Bu hafta **47** Bir hafta önce **47** Bir ay önce **63**

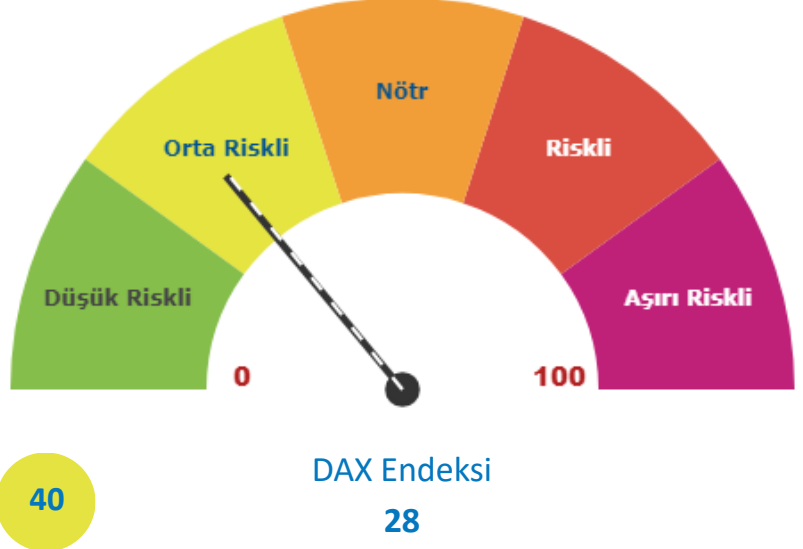


## DAX

Almanya Hisse Senedi modeli bulunduğu **orta riskli** bölge içinde konumunu korumaktadır.

Modelin 1 aylık düşük riskli yönde hareketi sırasında DAX Endeksinde yaklaşık **%10 getiri gözlenmiştir**.

Bu hafta **28** Bir hafta önce **28** Bir ay önce **40**

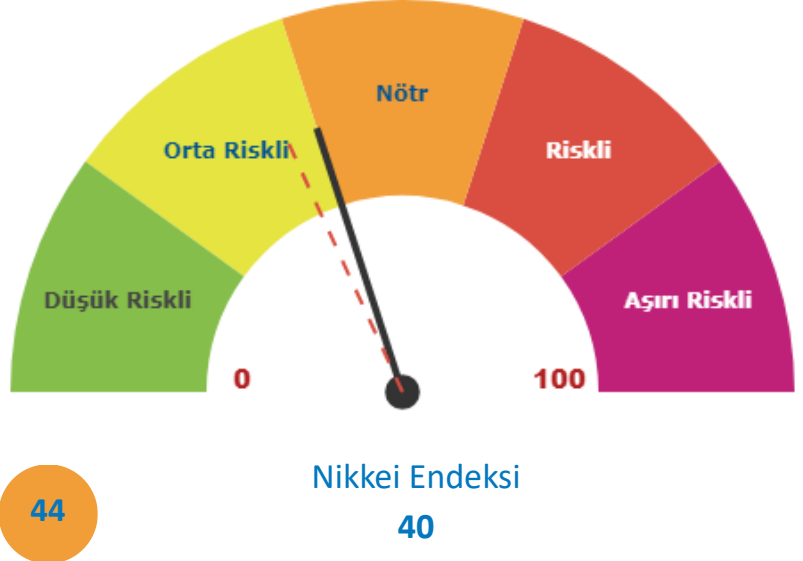


## NIKKEI

Japonya Hisse Senedi modeli 3 hafta önce geçiş yaptığı **orta riskli** bölge içinde riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin 1 haftalık riskli yöndeki hareketi ile aynı dönemde Nikkei Endeksinde yaklaşık **%1 değer kaybı**, 1 ayda düşük riskli yönde ilerlerken ise yaklaşık **%8.5 getiri gözlenmiştir**.

Bu hafta **40** Bir hafta önce **36** Bir ay önce **44**

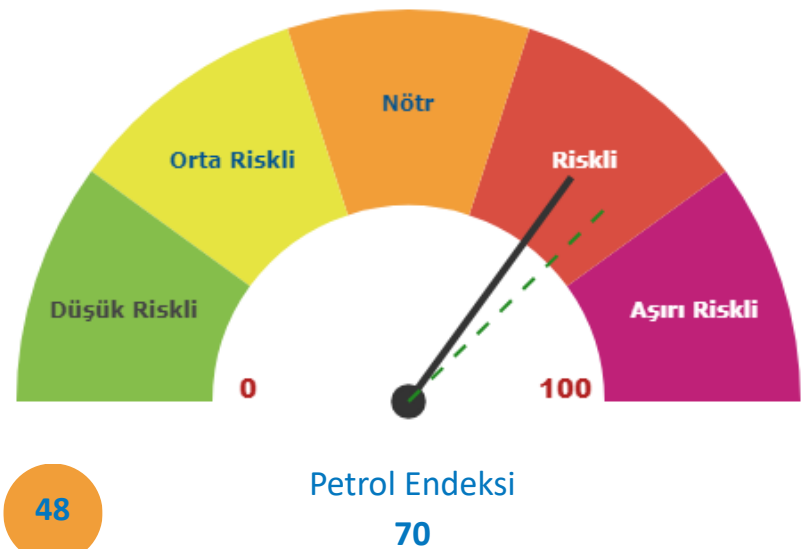


## PETROL

Petrol modeli bu hafta 3 haftadır bulunduğu **riskli bölge** içinde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin 1 haftalık düşük riskli yönde hareketi ile aynı dönemde petrol fiyatları yaklaşık **%1 değer kazanmış**, 1 aylık riskli yönde hareketi sırasında ise yaklaşık **%7.5 değer kaybetmiştir**.

Bu hafta **70** Bir hafta önce **75** Bir ay önce **48**



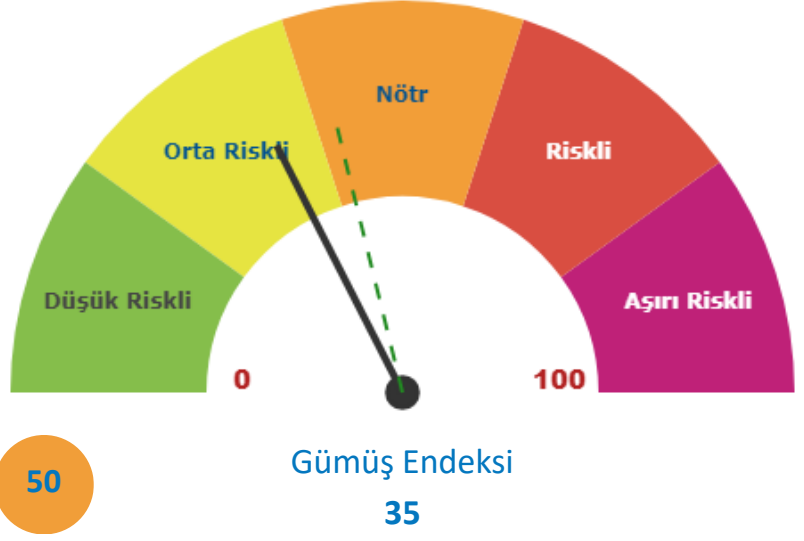
# RİSKOMETRE

## GÜMÜŞ

4 - 11 Aralık 2023

Gümüş modeli 1 ay önce nötr bölge ortasında yer alırken bu hafta da düşük riskli yönde ilerleyerek **orta riskli** bölgeye geçiş yapmıştır.

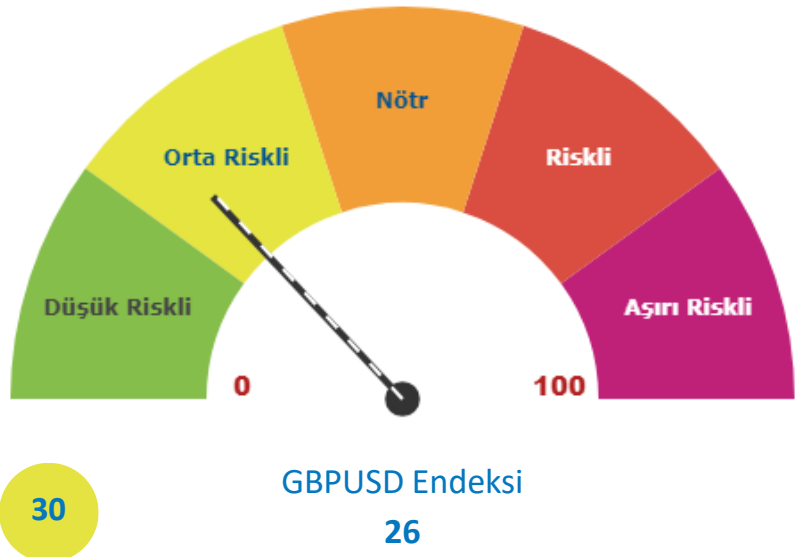
Modelin 1 haftalık ilerleyişi ile aynı dönemde gümüş fiyatları yaklaşık **%5**, 1 ayda ise yaklaşık **%11 değer kazanmıştır**.



## GBPUSD

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

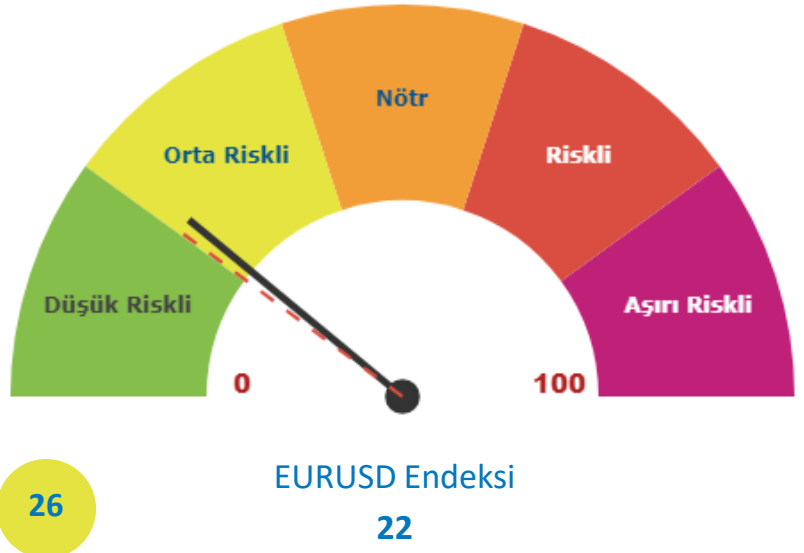
GBPUSD paritesi 1 ayda yaklaşık **%4 değer kazanmıştır**.



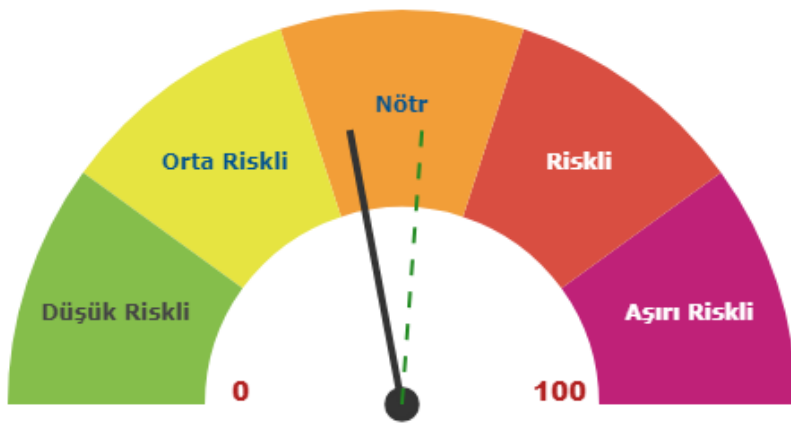
## EURUSD

EURUSD modeli geçen hafta geçiş yaptığı düşük riskli bölge sınırından **orta riskli** bölgeye dönüş yapmıştır.

Modelin 1 haftalık riskli yöndeki hareketi sırasında EURUSD paritesi yaklaşık **%1 değer kaybetmiş**, 1 aylık düşük riskli yönde hareketi sırasında ise yaklaşık **%3 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."