

RİSKOMETRE

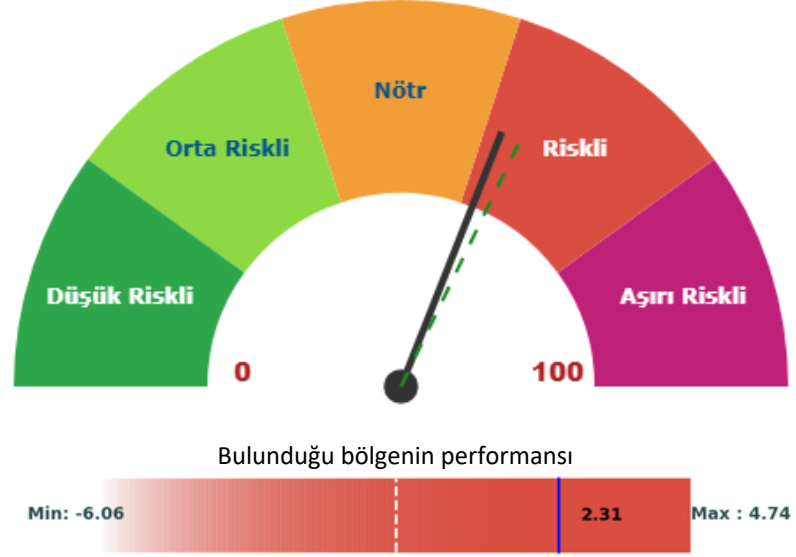
BIST100

30 Aralık - 5 Ocak 2024

BIST100 Modeli bu hafta **riskli bölge** içinde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

BIST100 Endeksi, modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada **yaklaşık %2.5 değer kazanmıştır**. Model bu bölgeye girdiğinden beri BIST100 Endeksi performansı, bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır**.

Bu hafta **62** Bir hafta önce **64** Bir ay önce **60**

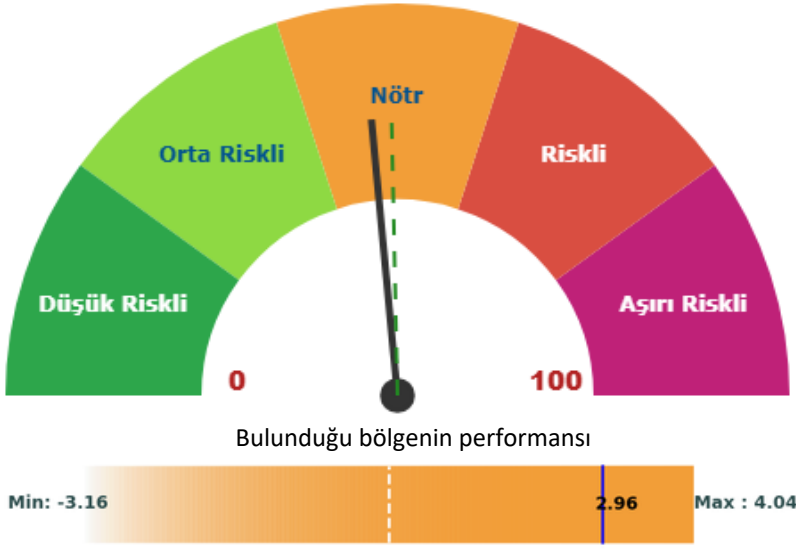


BIST TEKNOLOJİ

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

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada BIST Teknoloji Endeksi **yaklaşık %3 değer kazanmıştır**. BIST Teknoloji Endeksi performansı nötr bölgeye girdiğinden beri **bu bölgedeki tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır**.

Bu hafta **47** Bir hafta önce **49** Bir ay önce **36**

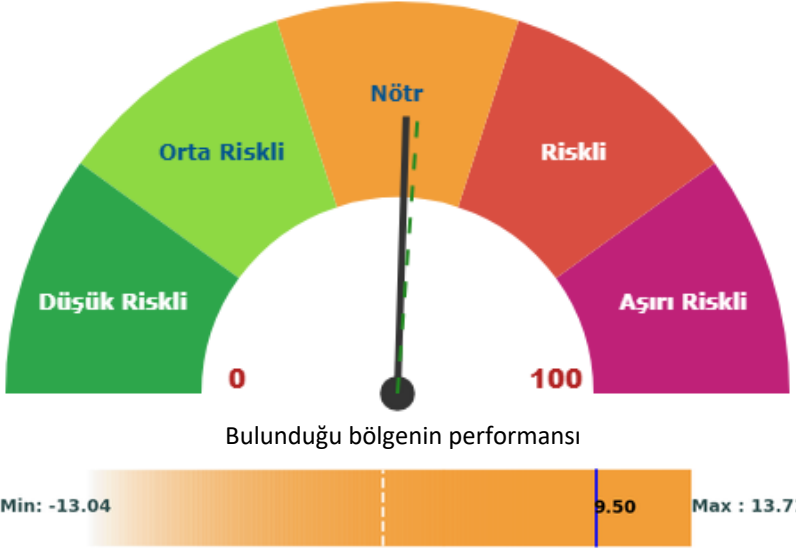


BIST BANKACILIK

BİST Bankacılık modeli bu hafta **nötr bölge** içinde düşük riskli yöne ilerleyerek 1 ay önceki konumuna dönüş yapmıştır.

BIST Bankacılık Endeksi, modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada yaklaşık **%6 değer kazanmıştır**. Model nötr bölgeye girdiğinden beri BIST Bankacılık Endeksi performansı bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır**.

Bu hafta **51** Bir hafta önce **52** Bir ay önce **51**



BIST SINAI

1 aylık dönemde **orta riskli** bölgede yer alan BİST Sınai modeli bu hafta riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin orta riskli sinyali verdiği 1 ayda BIST Sınai Endeksi **%2.75 getiri sağlamıştır**. Model bu bölgeye girdiğinden beri BIST Sınai Endeksi performansı bölgedeki tarihsel **ortalamasının altında seyretmektedir**.

Bu hafta **39** Bir hafta önce **36** Bir ay önce **39**

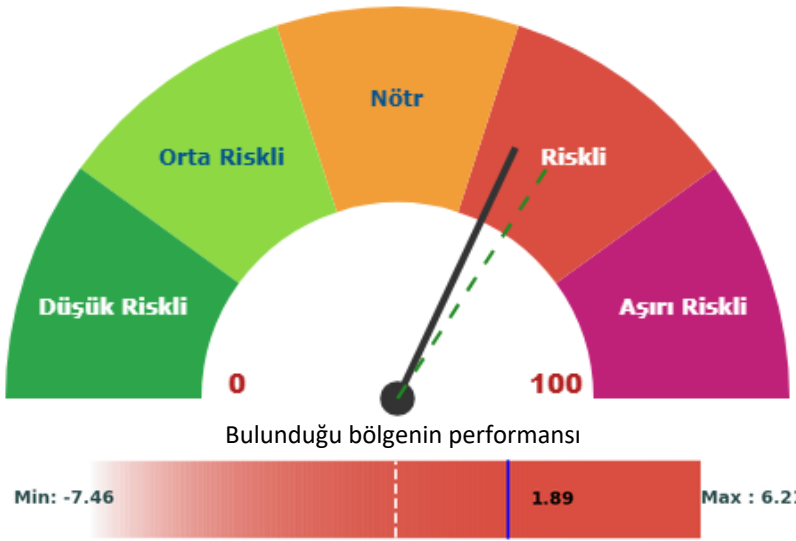


ALTIN

Geçtiğimiz hafta **riskli bölgeye** geçiş yapan Altın modeli bu hafta düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada Altın fiyatları **yaklaşık %1.5 değer kazanmıştır**. Model riskli bölgeye girdiğinden beri Altının getirisi bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde yer almaktadır**.

Bu hafta **64** Bir hafta önce **68** Bir ay önce **48**



RİSKOMETRE

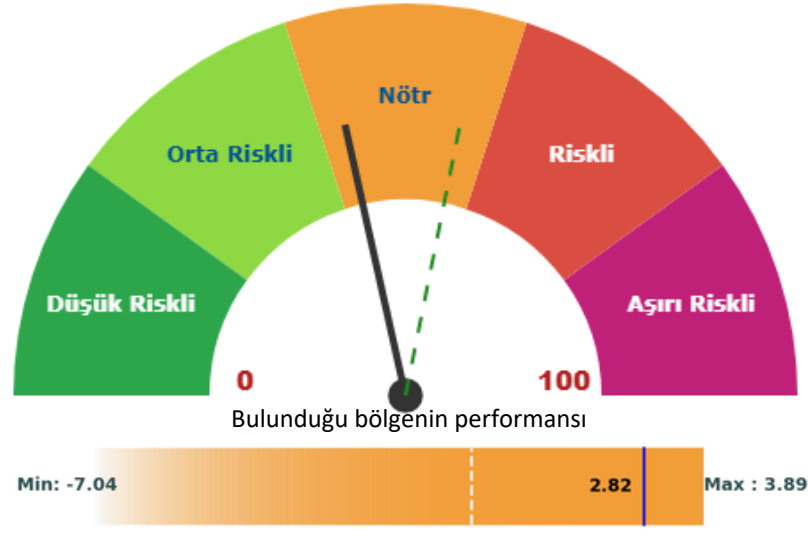
S&P

30 Aralık - 5 Ocak 2024

1 aylık dönemde riskli yöne ilerleyen ABD Hisse Senedi modeli bu hafta **nötr bölge** içinde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada S&P Endeksi **yaklaşık %3 getiri sağlamıştır**. Model nötr bölgeye girdiğinden beri S&P Endeksinin performansı, bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır**.

Bu hafta **43** Bir hafta önce **56** Bir ay önce **29**

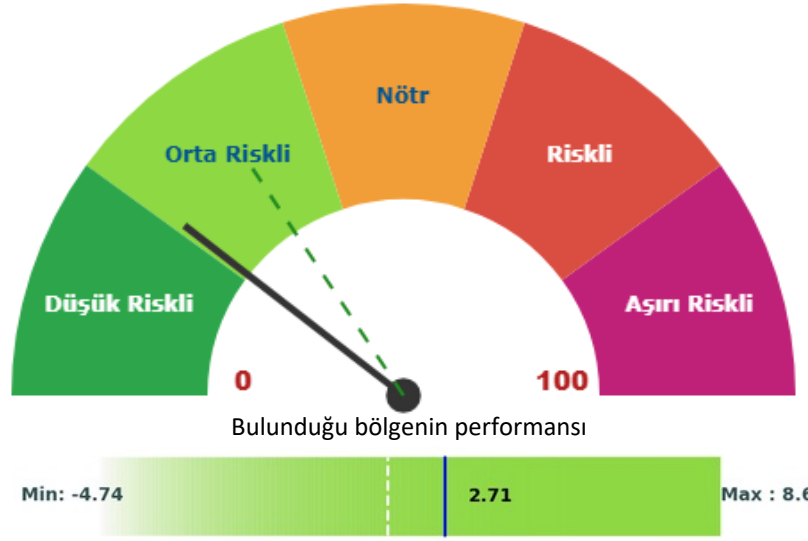


NASDAQ

NASDAQ modeli bu hafta geçen hafta geçiş yaptığı **orta riskli** bölge içinde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada endeks yaklaşık **%3.5 değer kazanmıştır**. Model orta riskli bölgeye girdiğinden beri endeksin getirisi bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde yer almaktadır**.

Bu hafta **21** Bir hafta önce **31** Bir ay önce **14**

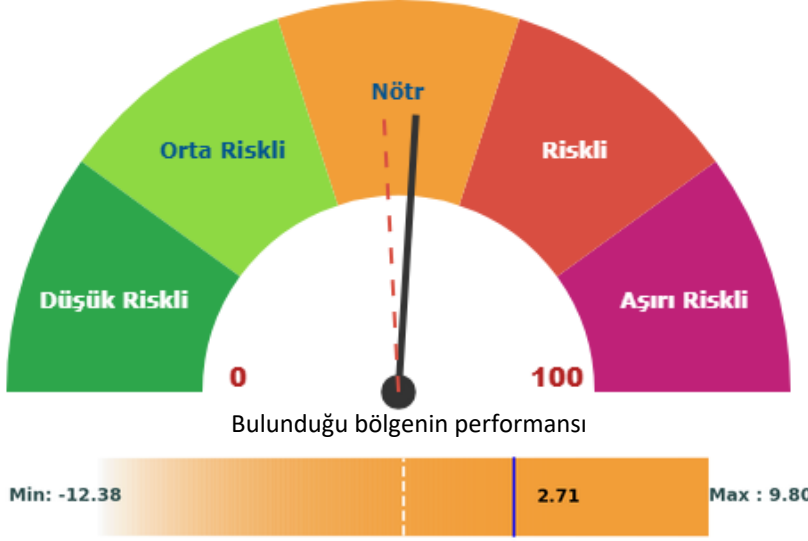


DAX

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

DAX Endeksi modelin nötr sinyali verdiği 1 ayda **yaklaşık %1.5 getiri sağlamıştır**. DAX Endeksi performansı nötr bölgeye girdiğinden beri bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır**.

Bu hafta **52** Bir hafta önce **48** Bir ay önce **52**

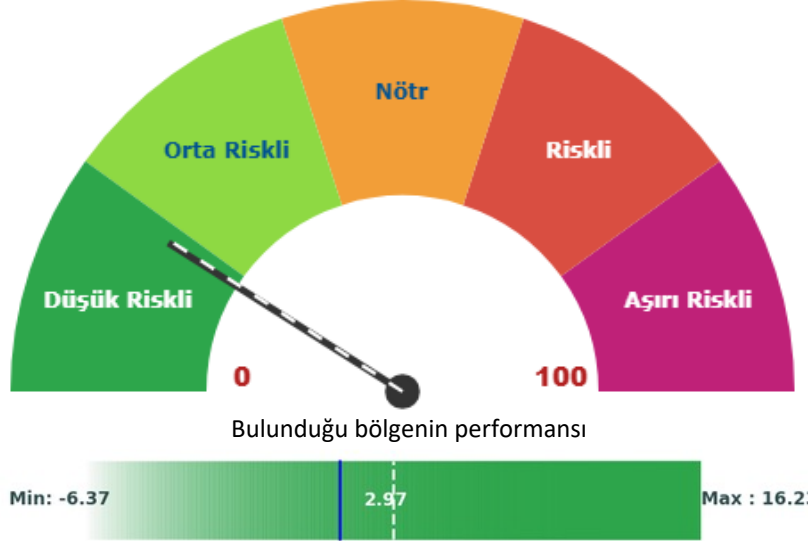


NIKKEI

Japonya Hisse Senedi modeli 1 aylık dönemde **düşük riskli** yöne ilerlemiştir.

Nikkei Endeksi, modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda **yaklaşık %5.5 değer kazanmıştır**. Nikkei Endeksinin getirisi düşük riskli bölgeye girdiğinden beri bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında bulunmaktadır**.

Bu hafta **18** Bir hafta önce **18** Bir ay önce **22**

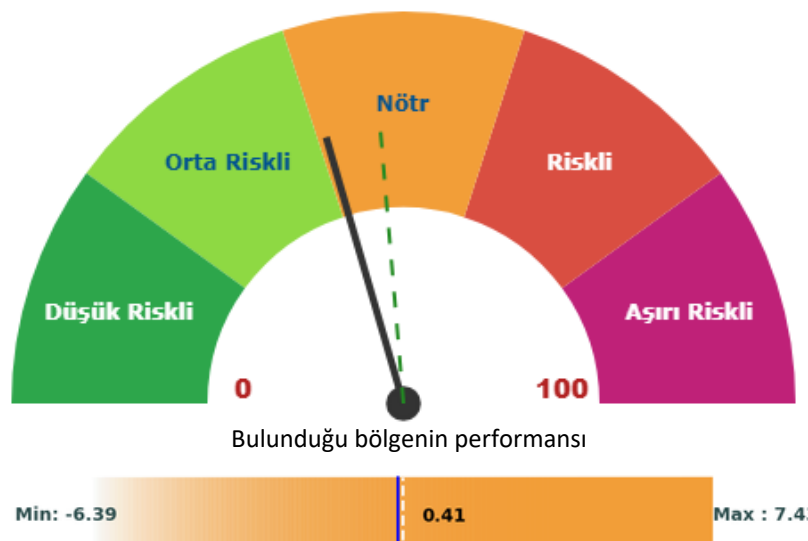


PETROL

Petrol modeli 1 aylık ve haftalık süreçte **nötr bölge** içinde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada petrol fiyatları **yaklaşık %1 değer kazanmıştır**. Model nötr bölgeye girdiğinden beri petrolün getirisi bu bölgedeki **tarihsel ortalamasında bulunmaktadır**.

Bu hafta **41** Bir hafta önce **47** Bir ay önce **43**



RİSKOMETRE

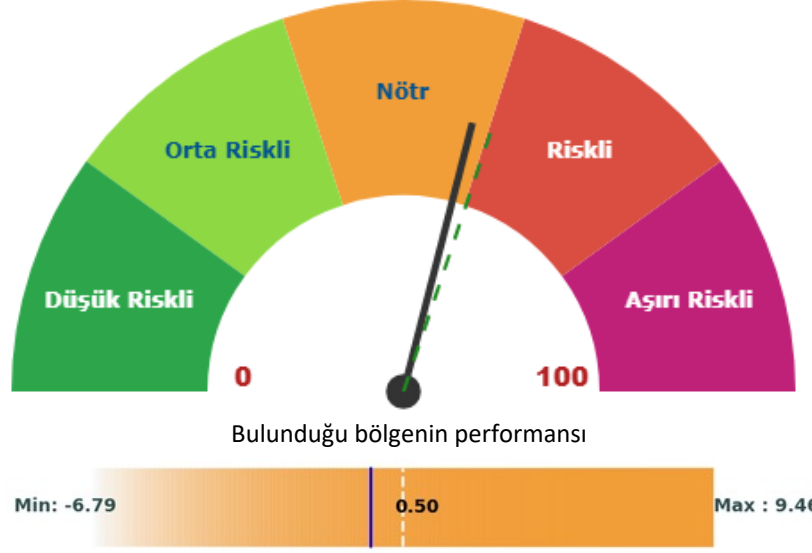
GÜMÜŞ

30 Aralık - 5 Ocak 2024

Gümüş modeli haftalık ve aylık dönemde **nötr bölgede** yer alırken bu hafta düşük riskli yöne ilerlemiştir

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 ayda Gümüş fiyatları yaklaşık **%3 değer kaybetmiştir**. Gümüşün getiri performansı bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında bulunmaktadır**.

Bu hafta **58** Bir hafta önce **60** Bir ay önce **49**

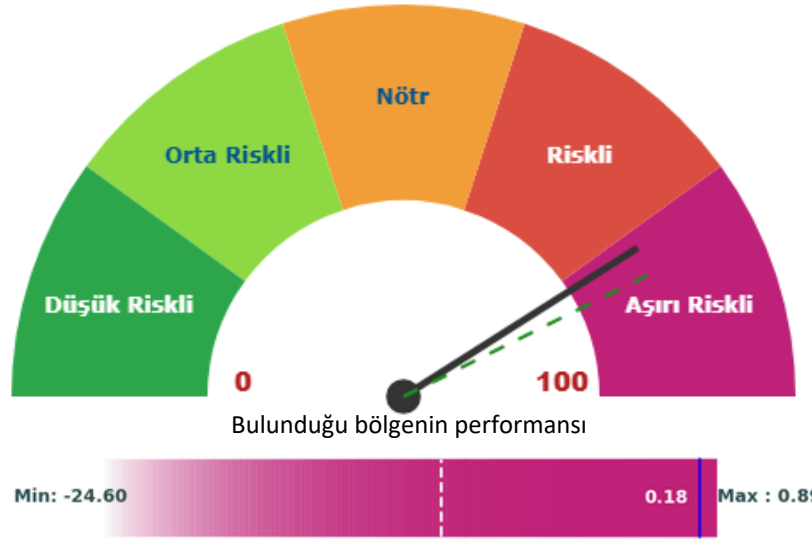


GBPUSD

GBPUSD modeli bu hafta geçen hafta geçiş yaptığı **aşırı riskli** bölge içinde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

GBPUSD paritesi modelin riskli yöne ilerlediği 1 ayda **yaklaşık %2 değer kaybetmiştir**. GBPUSD parite getirisi aşırı riskli bölgeye girdiğinden beri bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde yer almaktadır**.

Bu hafta **82** Bir hafta önce **85** Bir ay önce **72**

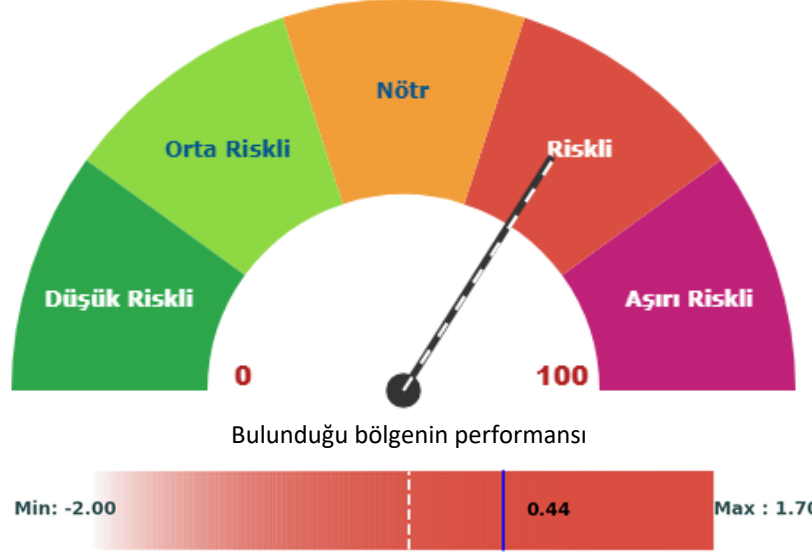


EURUSD

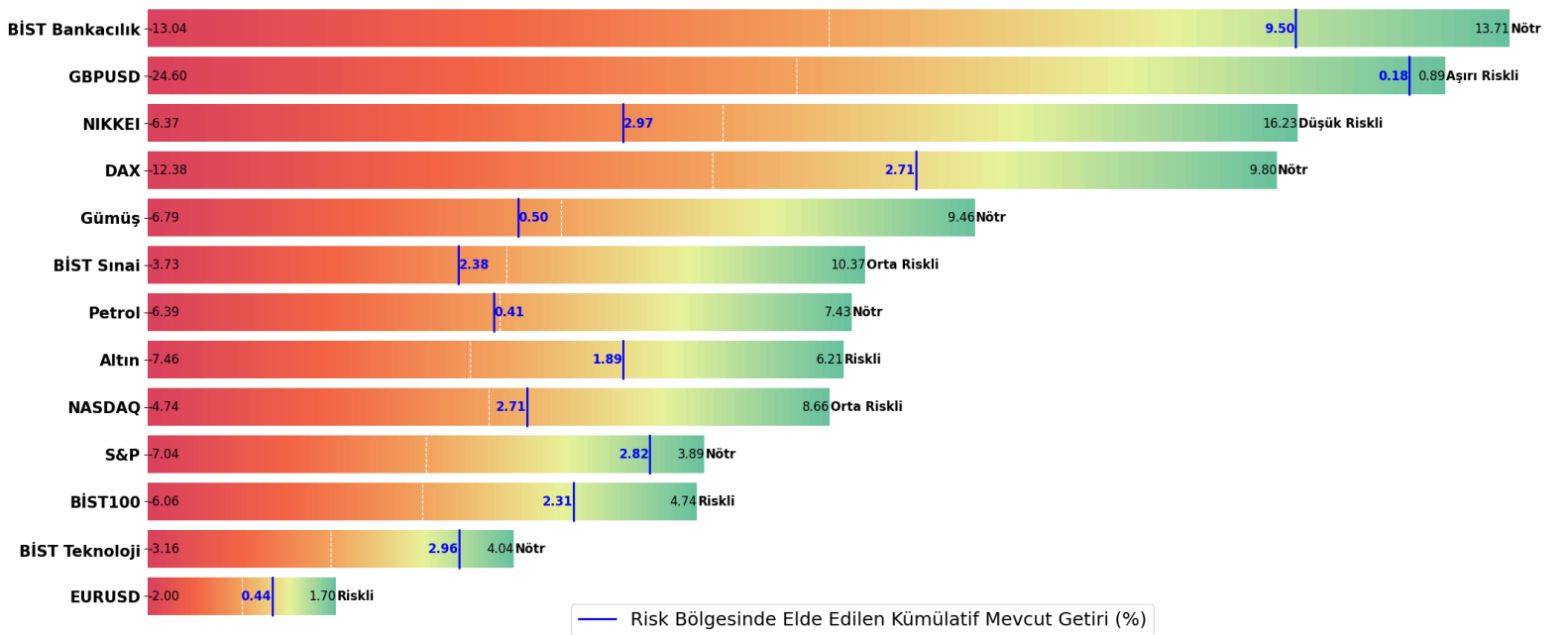
1 haftalık ve 1 aylık dönemde **riskli bölgede** yer alan EURUSD modeli bu hafta konumunu korumuştur.

Modelin riskli sinyali verdiği 1 haftada EURUSD paritesi **%0.2 değer kaybetmiştir**. Parite performansı riskli bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır**.

Bu hafta **68** Bir hafta önce **68** Bir ay önce **71**

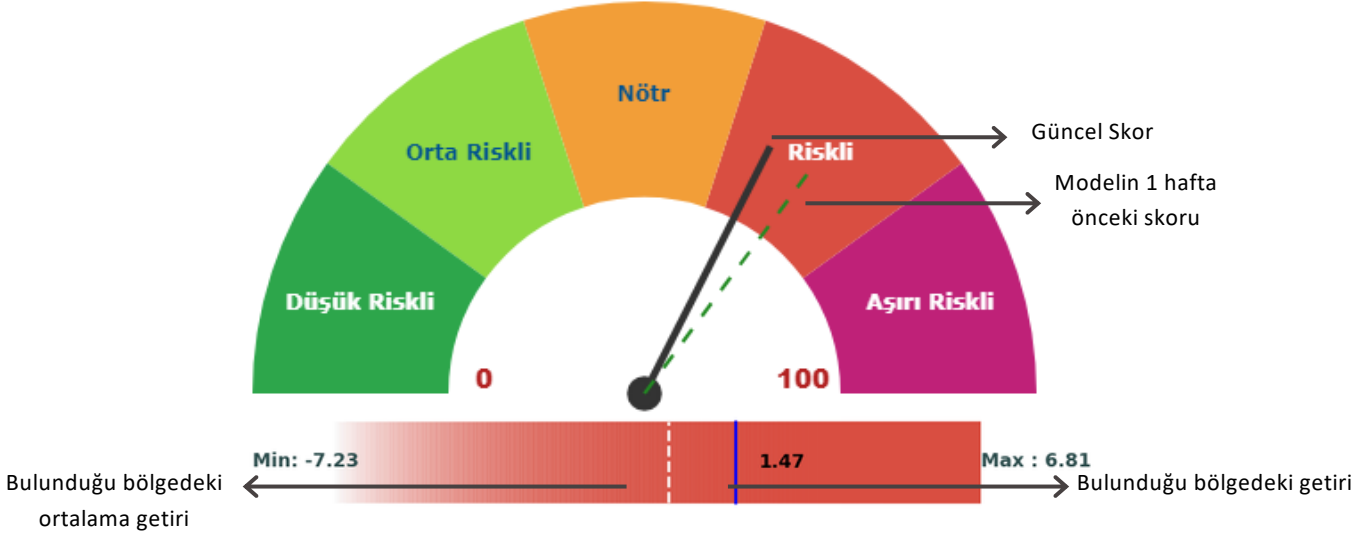


Bulduğu Bölgeye Göre Getiri Bantları



*Grafikte sunulan veriler, ilgili varlık modelinin mevcut bulunduğu risk bölgesi içerisinde kaydedilen kümülatif minimum ve maksimum getiri oranlarını temsil etmektedir. Kesikli beyaz renkli çizgi ise risk bölgesinde elde ettiği ortalama getiriyi göstermektedir. Mavi renk ile 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:

arfcap
www.arf.capital

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."