

RİSKOMETRE

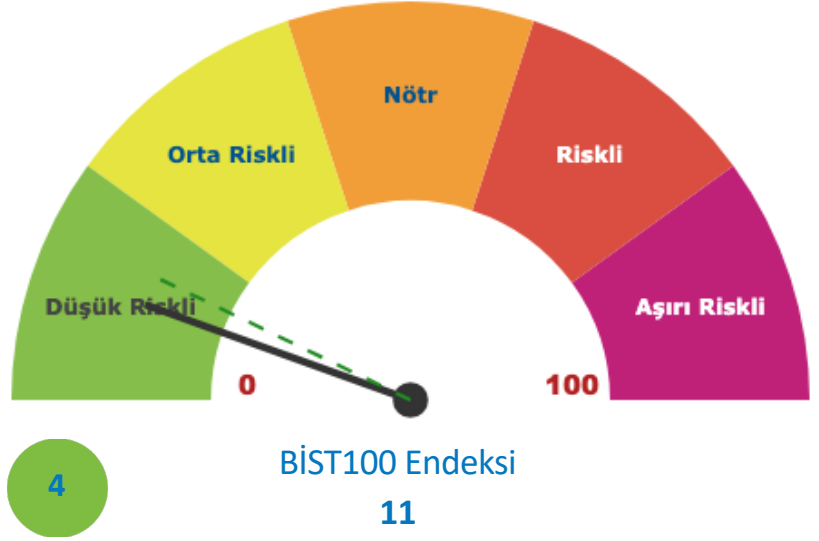
BİST100

11 - 17 Eylül 2023

BİST100 Modeli yaklaşık 1 aydır **düşük riskli** bölge içinde kalmaya devam ediyor.

Modelin **düşük riskli** bölgede risksiz yöne ilerlemesi, son 1 haftada BİST100 endeksine yaklaşık **%5 değer** kazandırmıştır.

Bu hafta **11** Bir hafta önce **14** Bir ay önce **4**

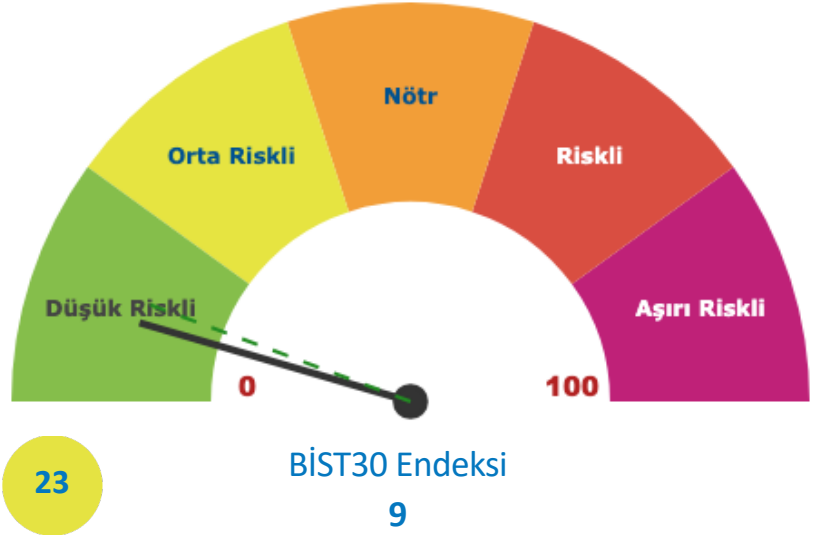


BİST30

BİST30 modeli 1 haftalık dönemde **düşük riskli** yönde ilerlerken BİST30 endeksi yaklaşık **%5 getiri** sağlamıştır.

Modelin son 1 aylık dönemde orta riskli bölgeden **düşük riskli** bölgeye geçişi sırasında BİST30 Endeksi yaklaşık **%9 değer** kazanmıştır.

Bu hafta **9** Bir hafta önce **11** Bir ay önce **23**

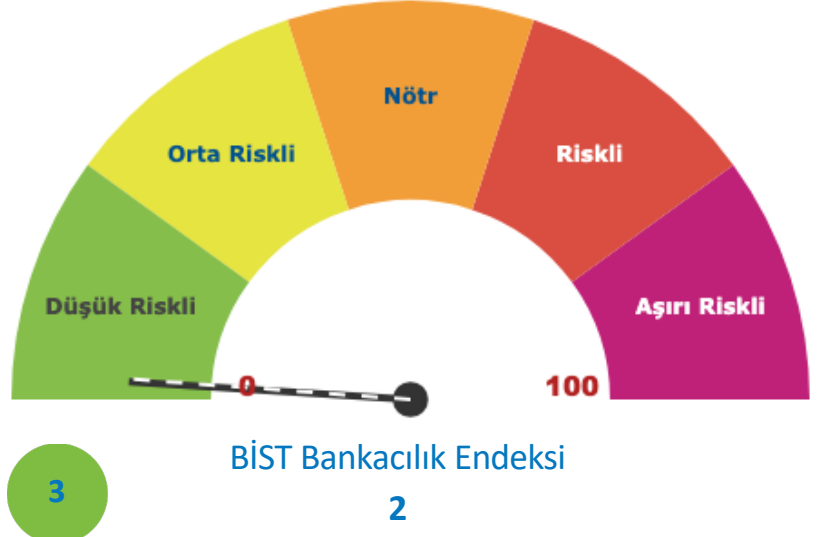


BİST BANKACILIK

BİST Bankacılık modeli son 1 aylık dönemde **düşük riskli** bölge alt sınırında yer almaya devam ediyor.

1 aylık dönemde modelin düşük riskli yöndeki sınırlı hareketi ile BİST Bankacılık endeksi **%20'in üzerinde getiri** sağlamıştır.

Bu hafta **2** Bir hafta önce **3** Bir ay önce **3**

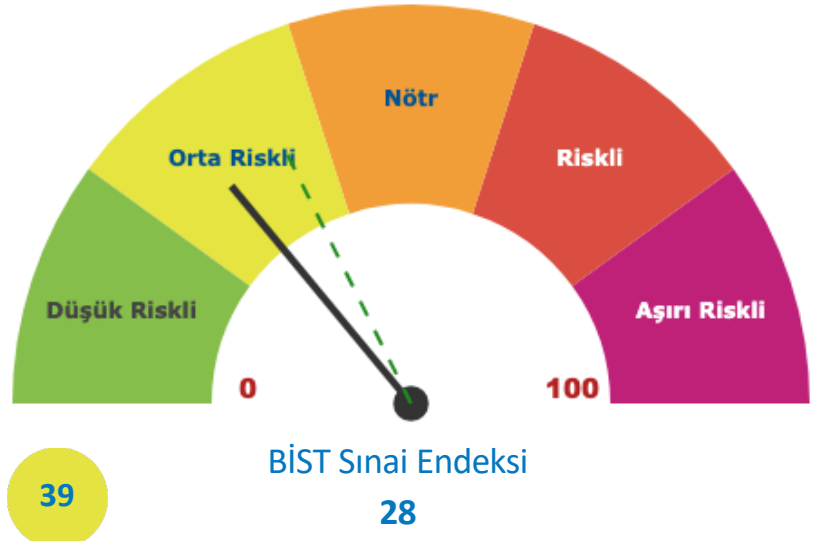


BİST SINAI

BİST Sınai modeli yaklaşık 1 aydır **orta riskli** bölge içinde yer alıyor.

Modelin son 1 haftada ve son 1 ayda ki orta riskli bölgeden, **düşük riskli** yöne hareketi ile BİST Sınai Endeksi yaklaşık **%5 değer** kazanırken, son 1 ayda ise bu oran **%15'in** üzerindedir.

Bu hafta **28** Bir hafta önce **35** Bir ay önce **39**



ALTIN

Altın modeli son 1 haftalık dönemde nötr bölgeden **riskli bölgeye** geçiş yapmıştır.

Modelin son 1 haftadaki riskli bölgeye geçiş hareketi ile Altın fiyatları yaklaşık **%1.5 değer** kaybetmiştir.

Bu hafta **62** Bir hafta önce **55** Bir ay önce **62**



RİSKOMETRE

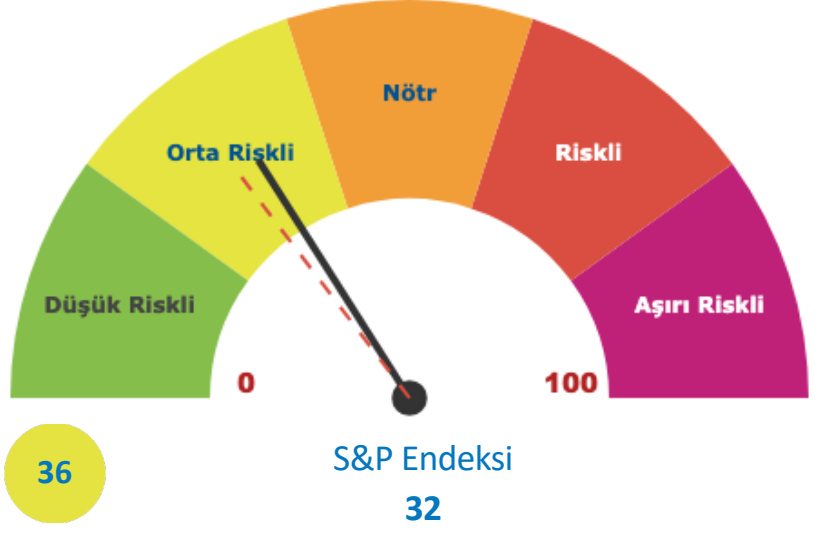
S&P

11 - 17 Eylül 2023

ABD Hisse Senedi modeli son 1 haftalık dönemde **orta riskli** bölge içinde riskli yönde ilerlemiştir.

Modelin bu sınırlı hareketi ile S&P Endeksi yaklaşık **%2 değer** kaybetmiştir.

Bu hafta **32** Bir hafta önce **29** Bir ay önce **36**

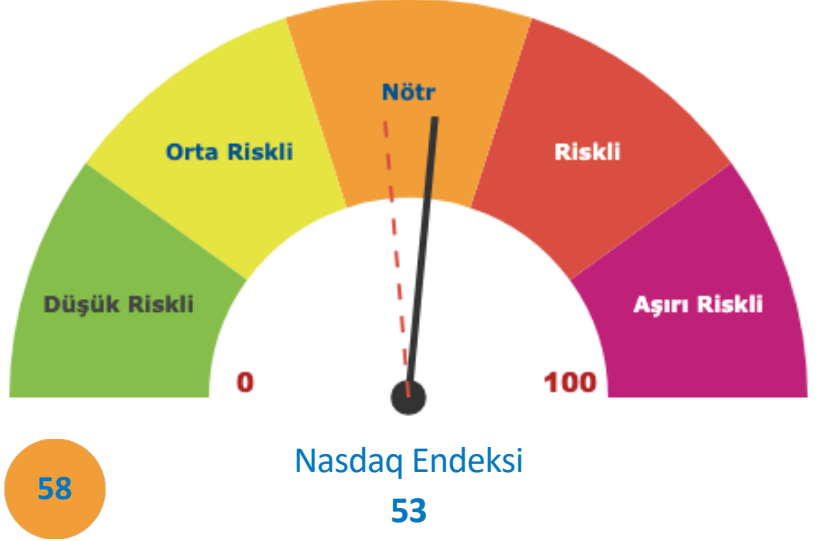


NASDAQ

Nasdaq modeli son 1 haftada **nötr bölge** içinde riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin bu hareketi sırasında Nasdaq Endeksi yaklaşık **%3 değer** kaybetmiştir.

Bu hafta **53** Bir hafta önce **47** Bir ay önce **58**

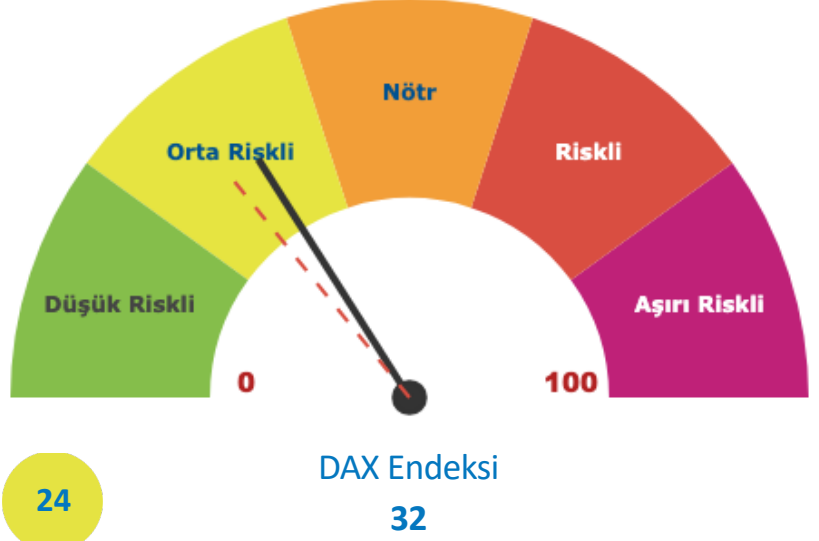


DAX

Alman Hisse Senedi modeli son 1 aydır **orta riskli** bölge içinde yer alıyor.

Modelin son 1 haftada orta riskli bölge içinde riskli yöndeki hareketi ile DAX endeksi yaklaşık **%1 değer** kaybetmiştir.

Bu hafta **32** Bir hafta önce **28** Bir ay önce **24**

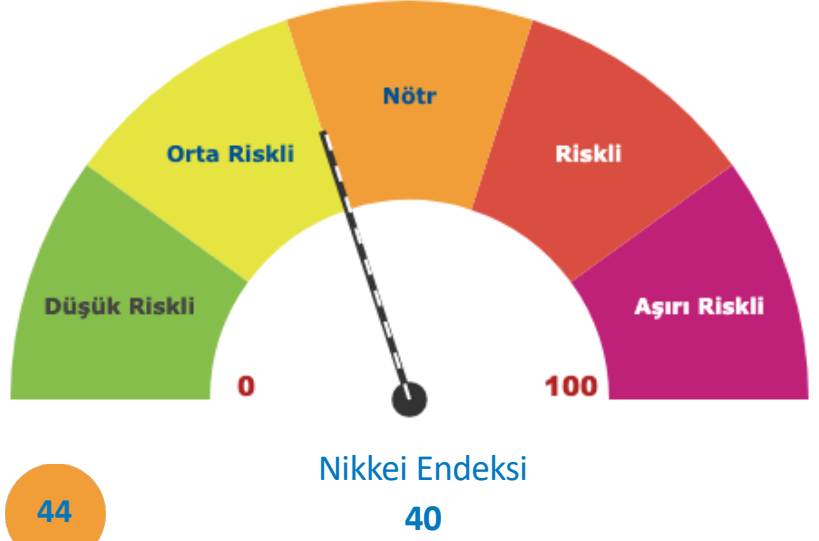


NIKKEI

Japonya modeli bu hafta da **orta riskli** bölge sınırında kalmaya devam ediyor.

Modelin son bir aylık dönemde nötr bölgeden **orta riskli** bölgeye geçişiyle Nikkei endeksinde **%3.5 getiri** gözlenmiştir.

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

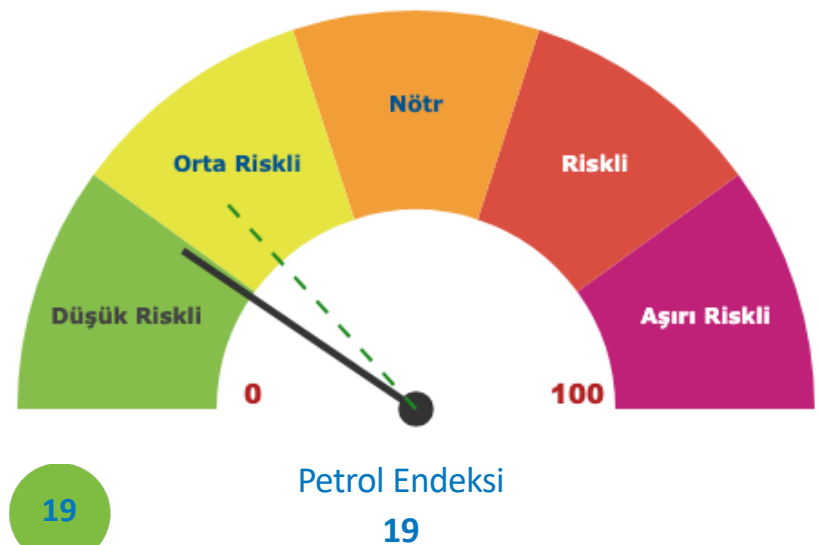


PETROL

Petrol modeli son 1 haftada orta riskli bölgeden **düşük riskli** yöne ilerlemiştir.

Modelin bu hareketiyle, petrol fiyatları **%3 değer** kazanmıştır.

Bu hafta **19** Bir hafta önce **26** Bir ay önce **19**



RİSKOMETRE

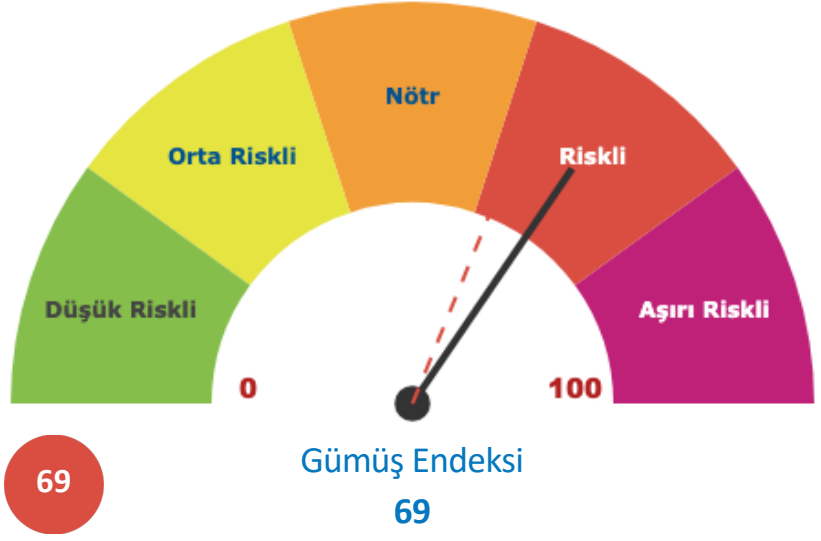
GÜMÜŞ

11 - 17 Eylül 2023

Gümüş modeli son 1 aylık dönemde **riskli bölge** içinde ilerlemeye devam ediyor.

Modelin riskli yöndeki hareketiyle gümüş fiyatları son 1 haftada yaklaşık **%6 değer** kaybetmiştir.

Bu hafta **69** Bir hafta önce **62** Bir ay önce **69**

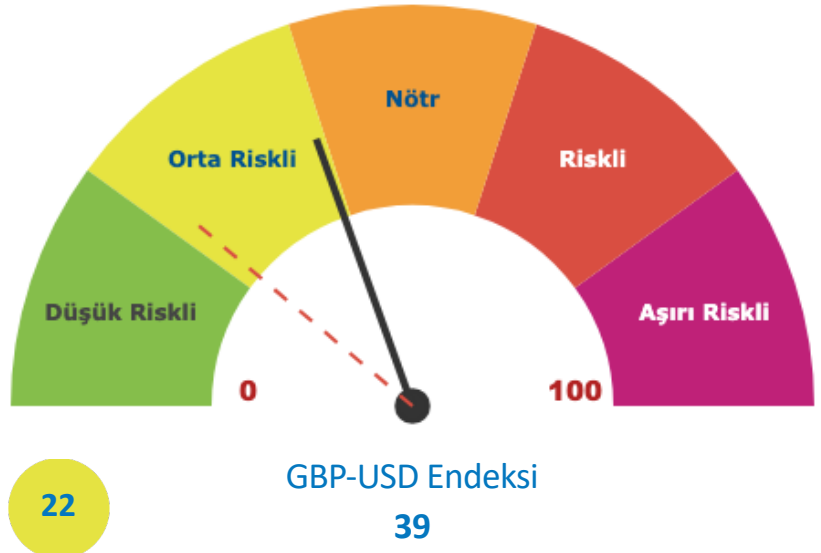


GBPUSD

GBPUSD modeli son 1 aylık dönemde **orta riskli** bölge içinde yer alıyor.

Modelin son 1 haftalık dönemde orta riskli bölge içinde, riskli yöndeki hareketi GBPUSD paritesi yaklaşık **%1,5 değer** kaybetmiştir.

Bu hafta **39** Bir hafta önce **22** Bir ay önce **22**

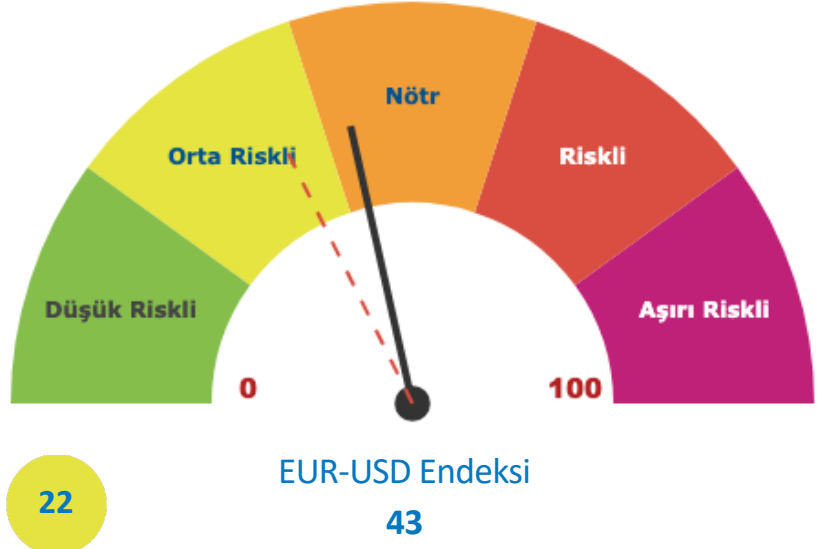


EURUSD

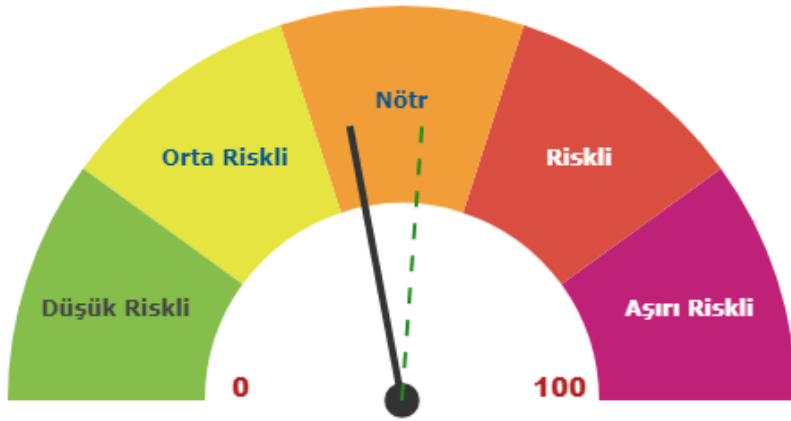
EURUSD modeli son 1 haftalık dönemde orta riskli bölgeden **nötr bölgeye** hareket etmiştir.

Modelin son 1 haftada riskli yöne ilerlemesi ile EURUSD paritesinde yaklaşık **%1.5 değer** kaybı yaşanmıştır.

Bu hafta **43** Bir hafta önce **35** Bir ay önce **22**



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."