

RİSKOMETRE

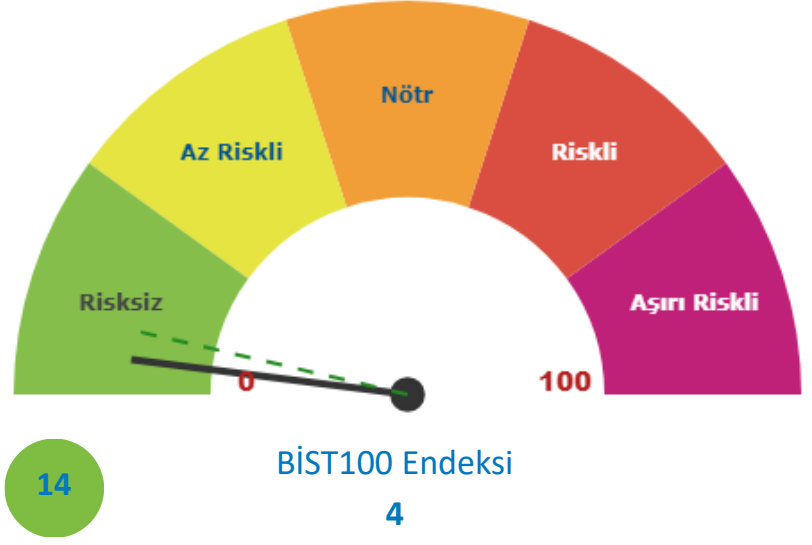
BIST100

14 - 20 Ağustos 2023

BIST100 modeli 1 haftalık dönemde **risksiz** bölgede risksiz yöndeki hareketini sürdürüyor.

Modelin risksiz yönde ilerlemesi süresince BIST100 Endeksi 1 haftalık dönemde **%2.5**, 1 aylık dönemde ise **%18.5 değer** kazanmıştır.

Bu hafta **4** Bir hafta önce **7** Bir ay önce **14**

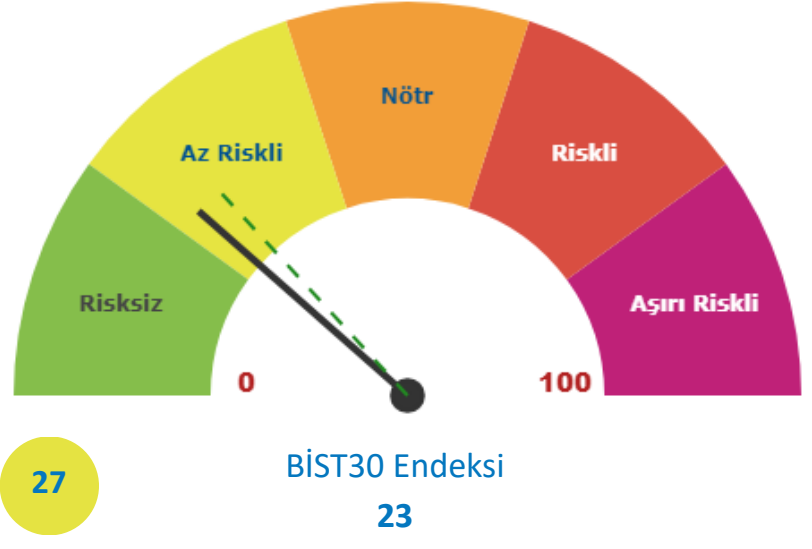


BIST30

BIST30 modeli son 1 haftalık dönemde **az riskli** bölge içinde risksiz yönde ilerlemiş ve bu hareket ile paralel olarak BIST30 endeksi **%3.6 getiri** sağlamıştır.

1 aylık dönemde ise model ile eş zamanlı olarak BIST30 endeksi de **%17 değer** kazanmıştır.

Bu hafta **23** Bir hafta önce **26** Bir ay önce **27**

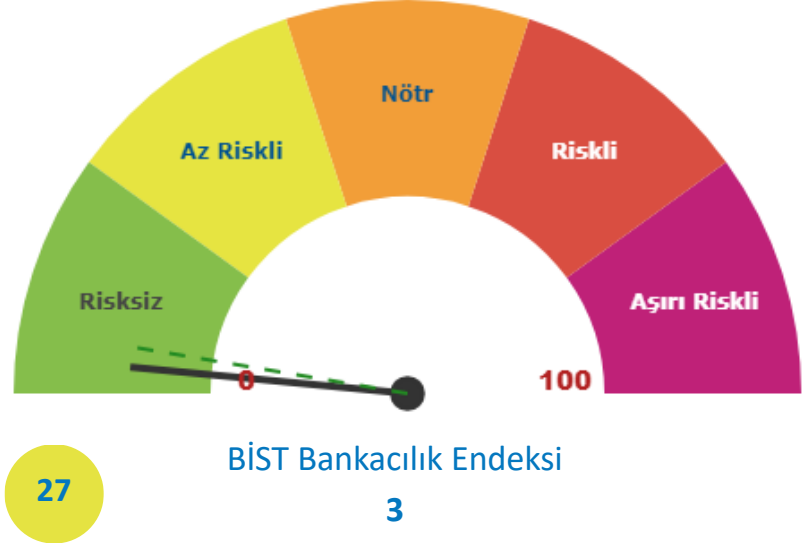


BIST BANKACILIK

BIST Bankacılık modeli 1 haftada **risksiz** bölgede risksiz yöne ilerlemiş ve BIST Bankacılık endeksi bu dönemde **%10 değer** kazanmıştır.

Modelin 1 aylık dönemde az riskli bölgeden risksiz bölgeye geçiş hareketi sırasında endeks **%34 getiri** sağlamıştır.

Bu hafta **3** Bir hafta önce **5** Bir ay önce **27**

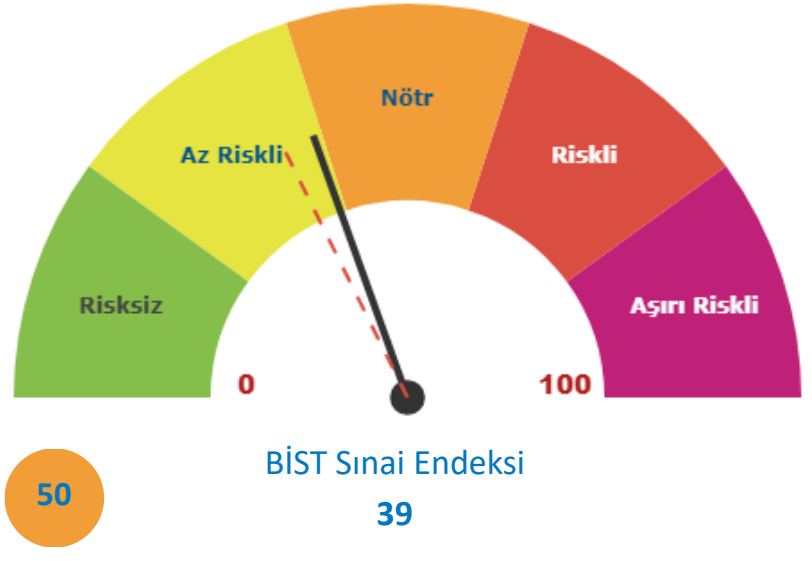


BIST SINAI

BIST Sınai modeli 1 haftada **az riskli** bölge içinde nötr bölge sınırına ilerlerken BIST Sınai endeksinde yaklaşık **%1,5 değer kaybı** gözlenmiştir.

Modelin 1 aylık süreçte nötr bölgeden az riskli bölgeye geçtiği süreçte BIST Sınai endeksi yaklaşık **%11 getiri** sağlamıştır.

Bu hafta **39** Bir hafta önce **35** Bir ay önce **50**

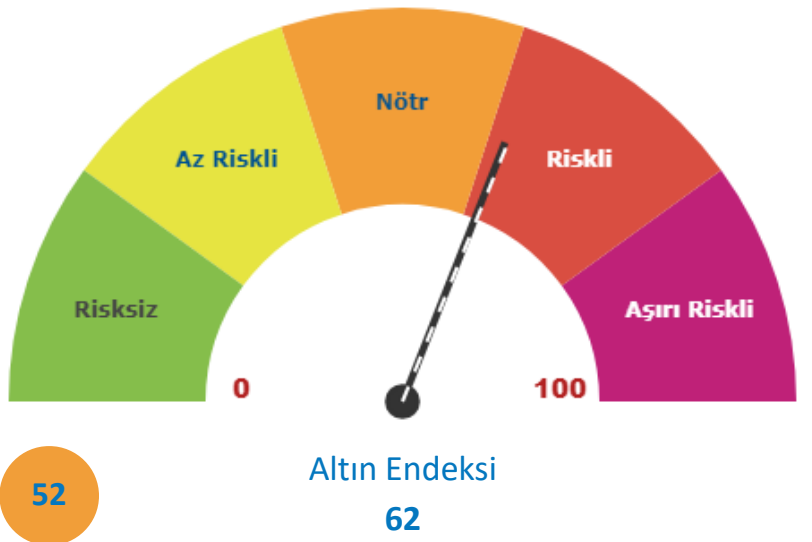


ALTIN

Altın modeli son 1 haftalık dönemde **riskli** bölgede stabil konumunu koruyor.

Modelin nötr bölgeden riskli bölgeye geçiş yaptığı 1 aylık dönemde Altın fiyatları yaklaşık **%1 değer** kaybetmiştir.

Bu hafta **62** Bir hafta önce **62** Bir ay önce **52**



RİSKOMETRE

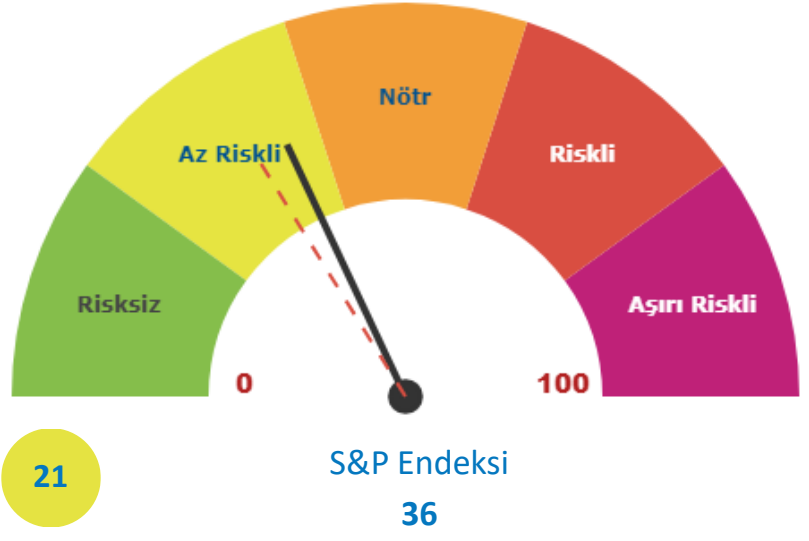
S&P

14 - 20 Ağustos 2023

ABD Hisse Senedi modeli **az riskli** bölge içinde riskli yönde ilerlemeye devam ediyor.

Modelin 1 haftada riskli yönde hareketi sırasında S&P Endeksinde **%1 değer** kaybı gözlenmiştir.

Bu hafta **36** Bir hafta önce **32** Bir ay önce **21**

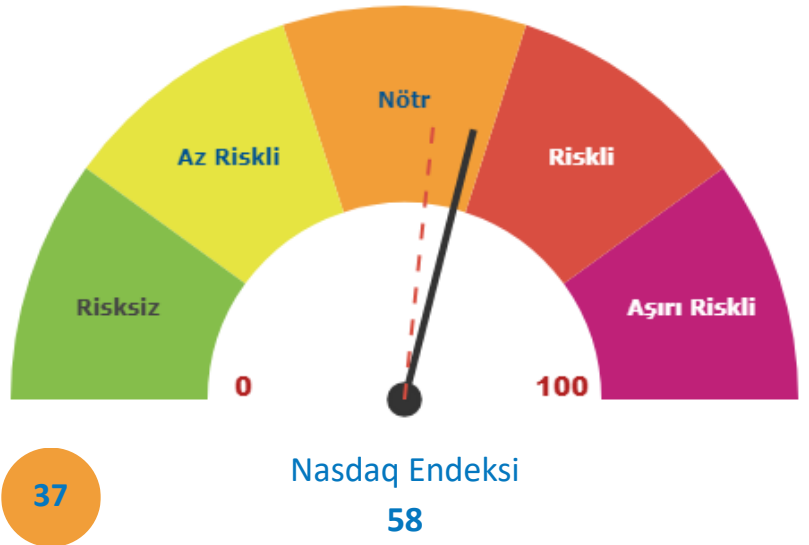


NASDAQ

NASDAQ modeli son 1 haftalık ve 1 aylık dönemde **nötr** bölge içinde riskli yönde ilerleyişini sürdürüyor.

Modelin 1 haftalık riskli yönde hareketi sırasında Nasdaq Endeksi yaklaşık **%1.5 değer** kaybı yaşamıştır.

Bu hafta **58** Bir hafta önce **53** Bir ay önce **37**

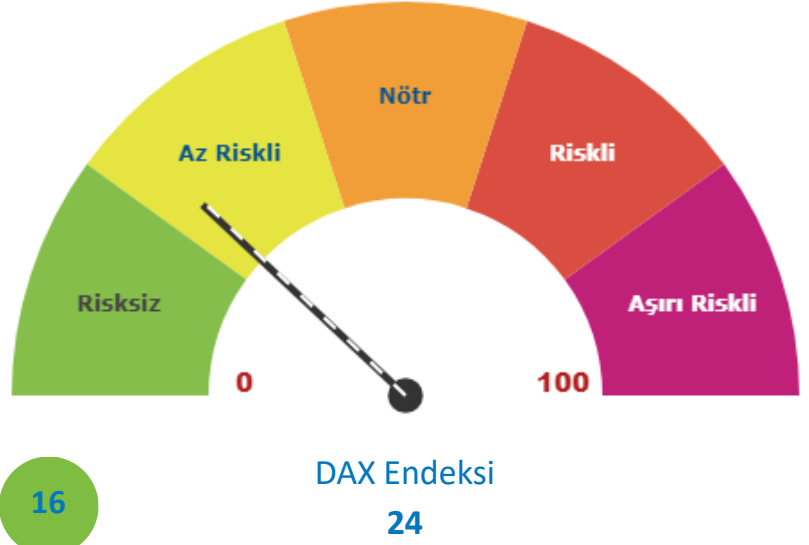


DAX

Alman Hisse Senedi modeli 1 haftalık süreçte **az riskli** bölge stabil kalmıştır.

Modelin 1 Aylık dönemde risksiz bölgeden az riskli bölgeye geçişi sırasında DAX endeksinde yaklaşık **%1 değer kaybı** gözlenmiştir.

Bu hafta **24** Bir hafta önce **24** Bir ay önce **16**

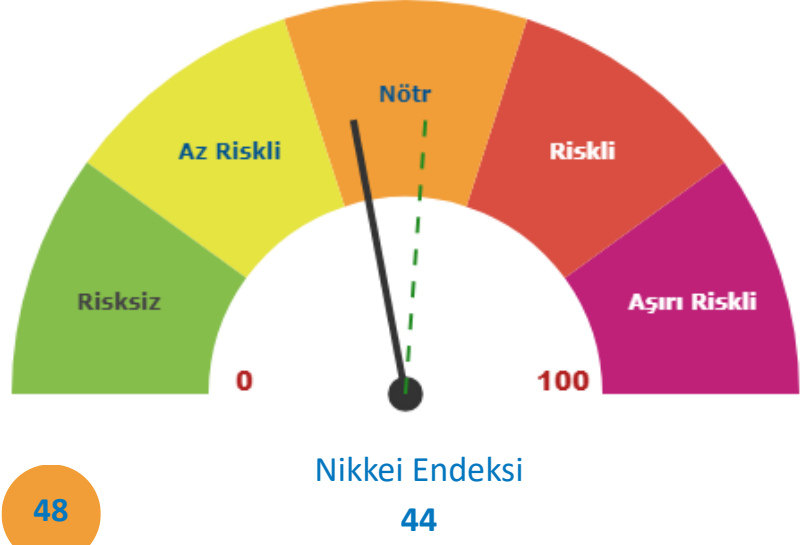


NIKKEI

Japonya Hisse Senedi modeli son 1 haftalık ve 1 aylık dönemde **nötr** bölge içinde dalgalı ve stabil konumunu koruyor.

Modelin 1 haftada risksiz yöndeki hareketi süresince Nikkei Endeksinde yaklaşık **%1 getiri** gözlenmiştir.

Bu hafta **44** Bir hafta önce **52** Bir ay önce **48**

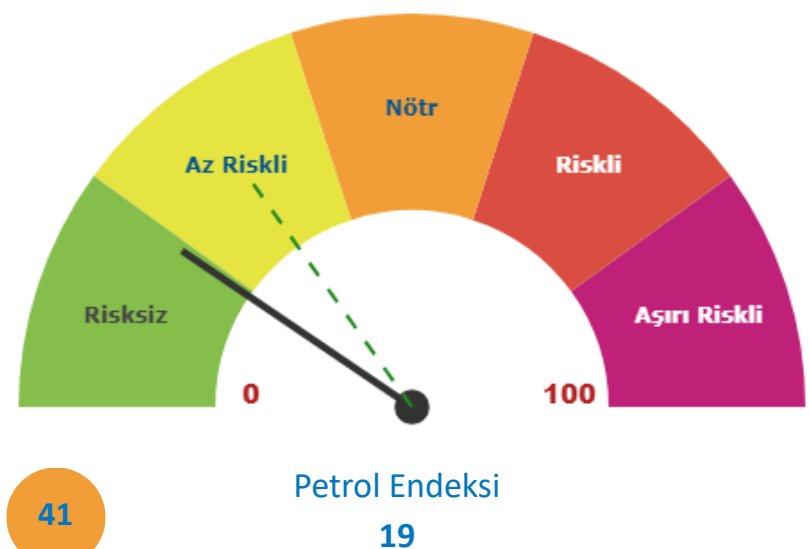


PETROL

Petrol modeli risksiz yönde hareketini sürdürürken 1 aylık dönemde nötr bölgeden **risksiz** bölgeye kadar ilerlemiştir.

Modelin 1 haftalık bölge değişimi esnasında petrol fiyatları **%1**, 1 aylık dönemde ise yaklaşık **%13 değer** kazanmıştır.

Bu hafta **19** Bir hafta önce **30** Bir ay önce **41**



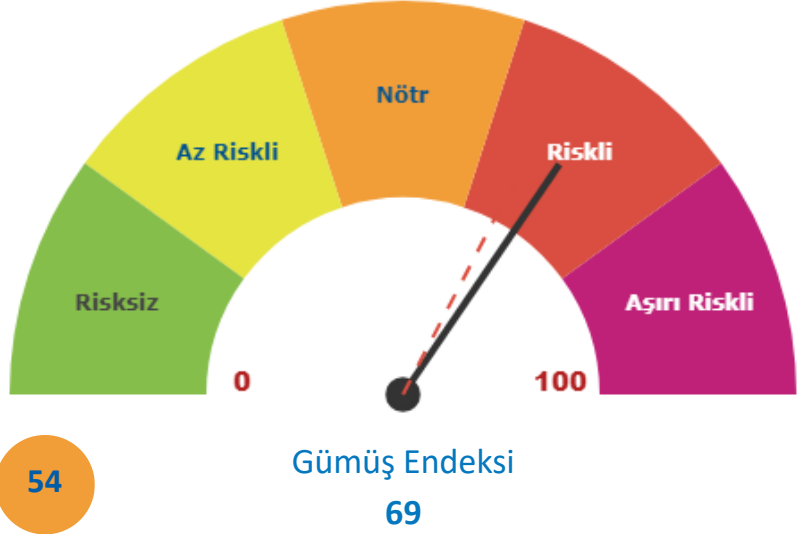
RİSKOMETRE

GÜMÜŞ

14 - 20 Ağustos 2023

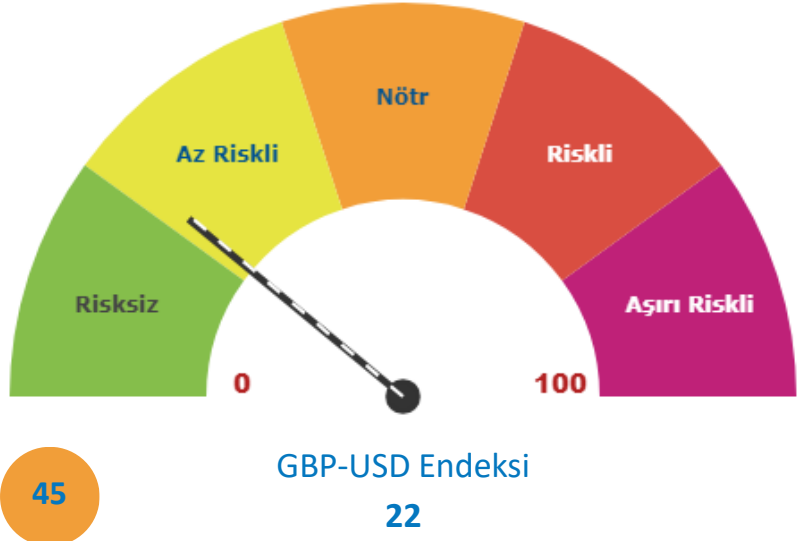
Gümüş modeli 1 hafta ve 1 aylık dönemde **riskli** yönde ilerlemeye devam ediyor.

Modelin riskli yöne ilerleyişi süresince Gümüş fiyatları **%3.5 değer kaybı** yaşamıştır.



GBP-USD

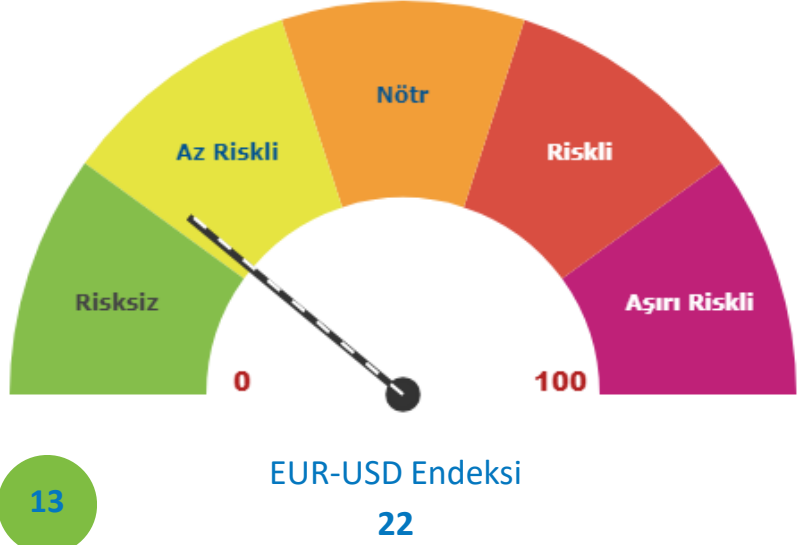
GBP-USD modeli 1 haftalık dönemde **az riskli** bölge içindeki görünümünü koruyor.



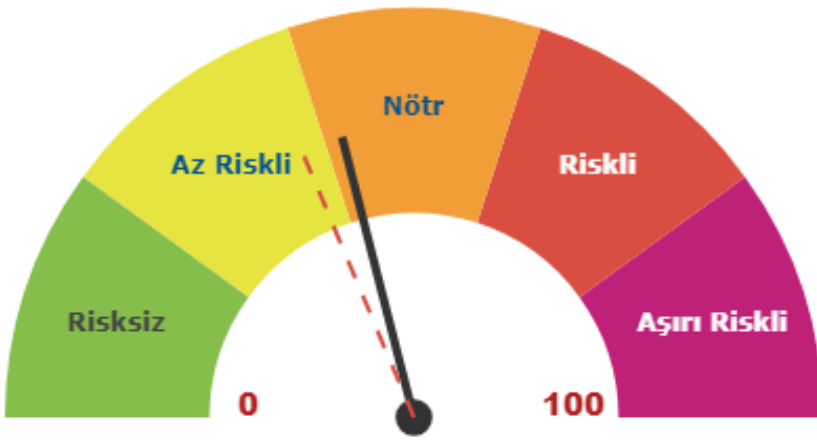
EUR-USD

EURUSD modeli 1 aylık dönemde risksiz bölgeden **az riskli** bölgeye geçiş yaparken son 1 haftada stabil kalmıştır.

Modelin 1 aylık hareketi süresince EUR-USD paritesi **%2 değer** kaybetmiştir.



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, değerler 0'a (Riskless) yaklaştığında piyasa daha cesaretli ve risk almayı benimseyen bir yaklaşım sergiler.

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."