

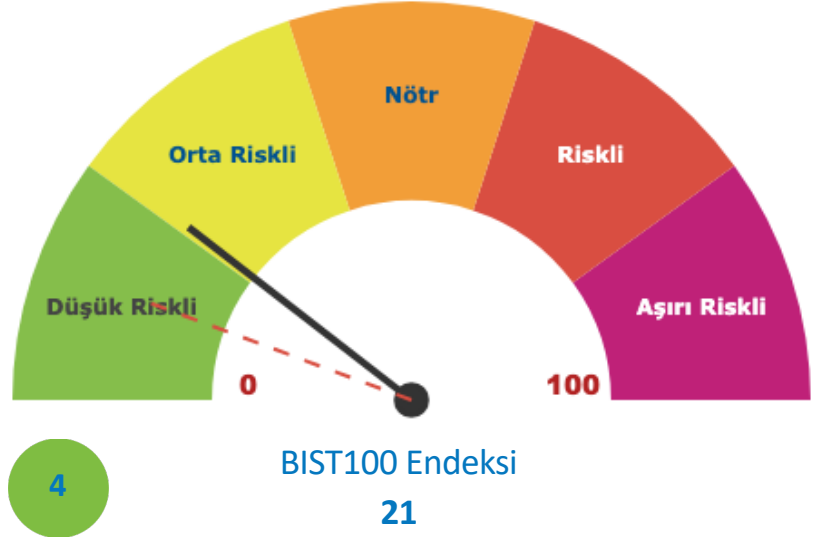
RİSKOMETRE

BIST100

18 - 24 Eylül 2023

BIST100 modeli bu hafta düşük riskli bölgeden **orta riskli** bölgeye geçiş yapmıştır.

Modelin riskli yöndeki hareketi ile BIST100 Endeksi yaklaşık **%4 değer** kaybetmiştir.

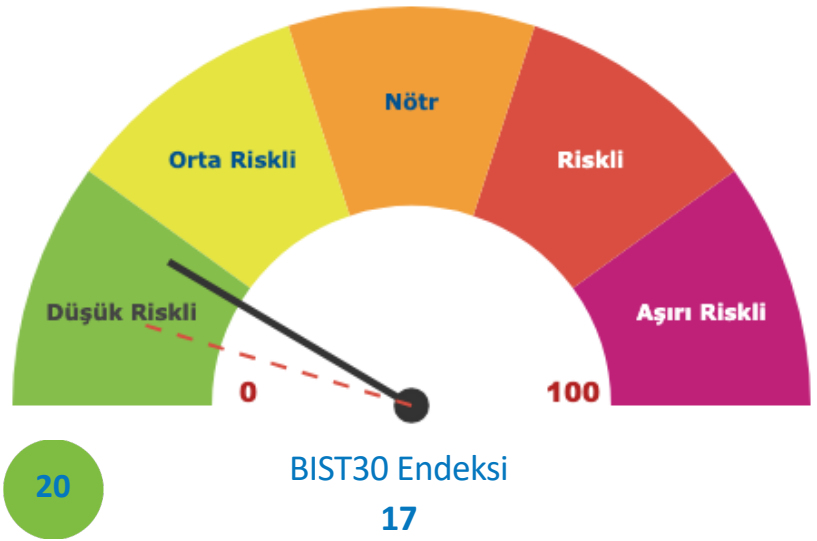


Bu hafta **21** Bir hafta önce **11** Bir ay önce **4**

BIST30

BIST30 modeli son 1 haftalık dönemde düşük riskli bölge içinde **riskli** yönde ilerlemiştir.

Modelin riskli yöndeki hareketi ile BIST30 Endeksi yaklaşık **%5 değer** kaybetmiştir.

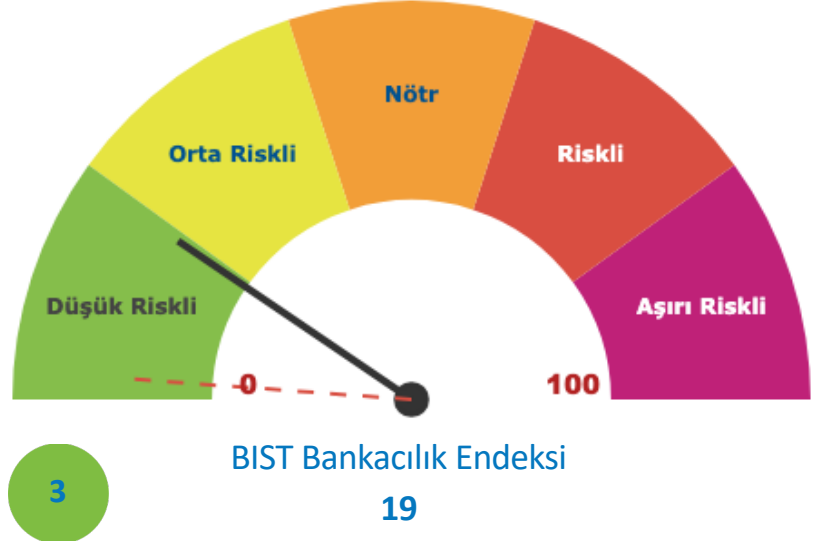


Bu hafta **17** Bir hafta önce **9** Bir ay önce **20**

BIST BANKACILIK

BIST Bankacılık modeli son 1 haftalık dönemde **düşük riskli** bölge içinde riskli yöne hareket etmiştir.

Modelin riskli yöndeki hareketi ile BIST Bankacılık endeksinde yaklaşık **%10 değer** kaybı gözlenmiştir.

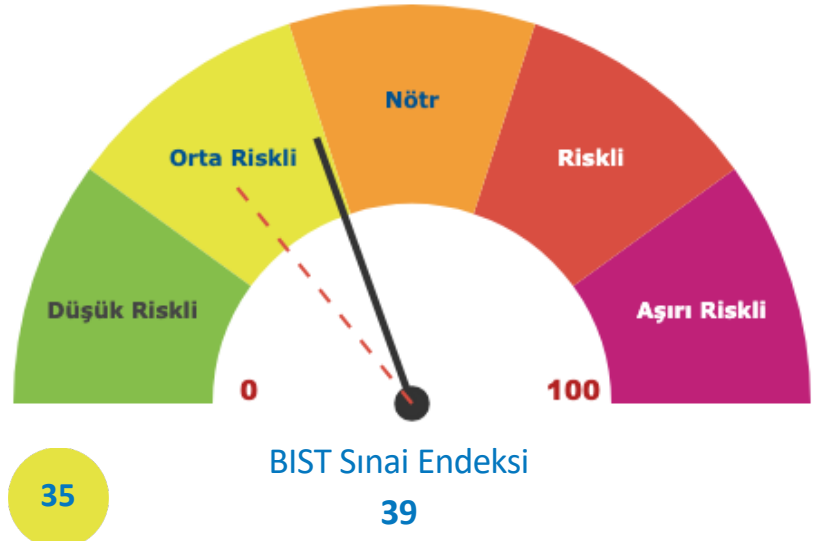


Bu hafta **19** Bir hafta önce **2** Bir ay önce **3**

BIST SINAI

BIST Sınai modeli orta riskli bölge içinde **riskli** yönde ilerlemiştir.

Modelin son 1 haftada **riskli** yöndeki hareketi ile BIST Sınai Endeksi yaklaşık **%4 değer** kaybetmiştir.

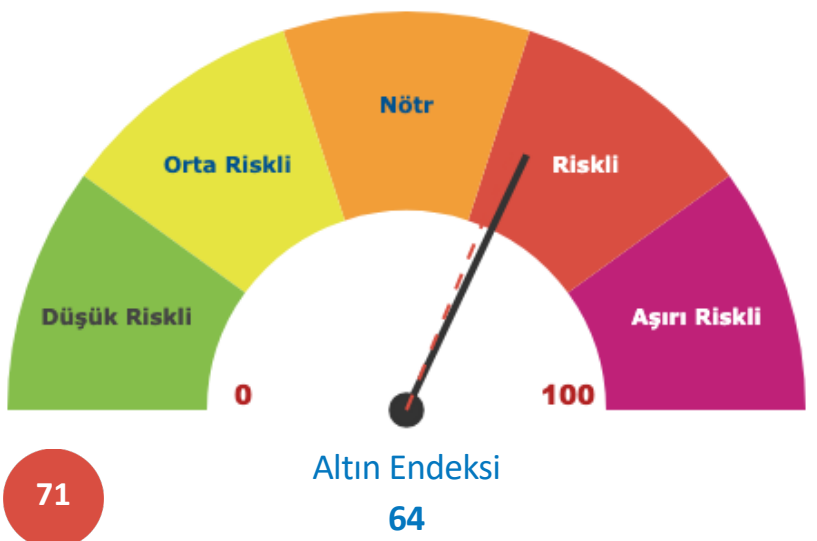


Bu hafta **39** Bir hafta önce **28** Bir ay önce **35**

ALTIN

Altın modeli son 1 aydır **riskli** bölgede yer alıyor.

Modelin son 1 haftalık stabil kalması ile Altın fiyatlarında ciddi bir değişim gözlenmemiştir.



Bu hafta **64** Bir hafta önce **62** Bir ay önce **71**

RİSKOMETRE

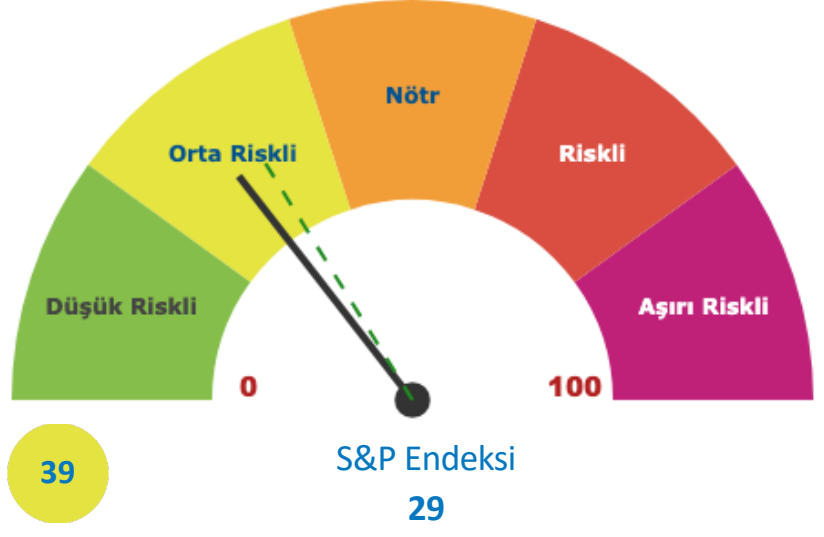
S&P

18 - 24 Eylül 2023

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

Modelin bu sınırlı hareketi ile S&P Endeksi yaklaşık **%1,5** değer kazanmıştır.

Bu hafta **29** Bir hafta önce **32** Bir ay önce **39**

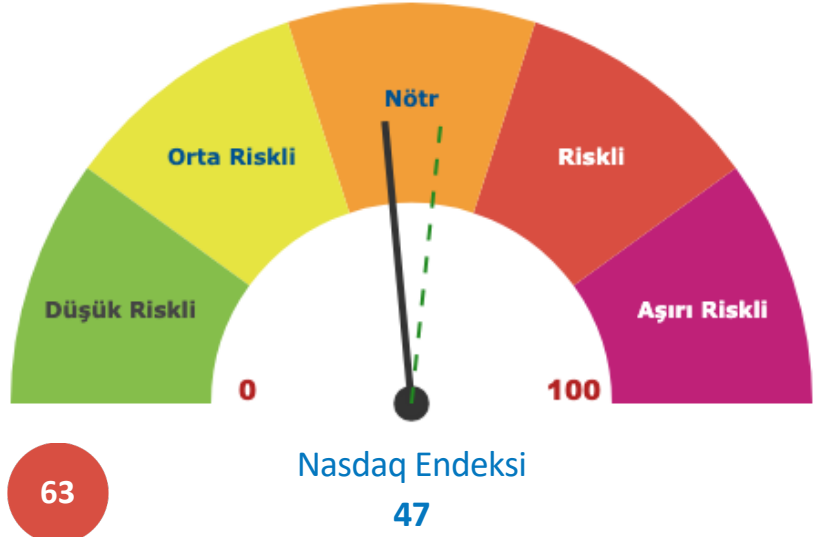


NASDAQ

Nasdaq modeli son 1 haftada **nötr** bölge içinde risksiz yönde ilerlemiştir.

Modelin bu hareketi sırasında Nasdaq Endeksi yaklaşık **%1,5** değer kazanmıştır.

Bu hafta **47** Bir hafta önce **53** Bir ay önce **63**

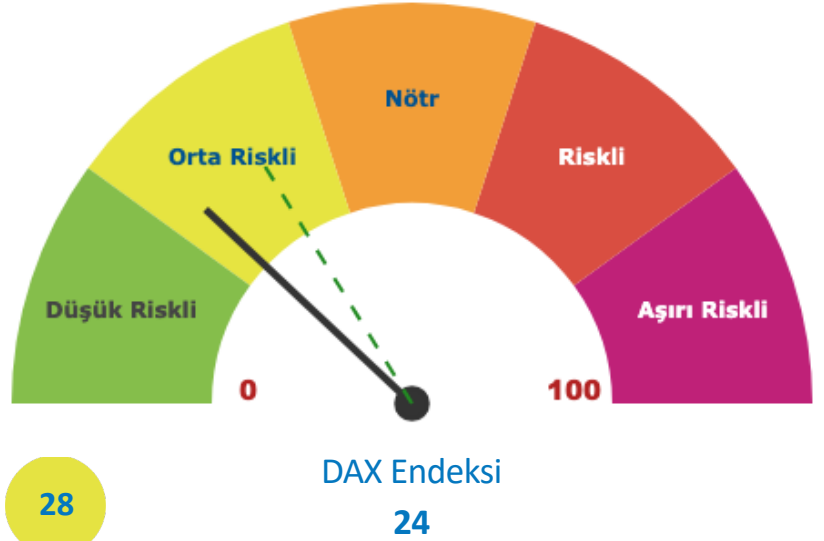


DAX

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

Modelin son 1 haftada orta riskli bölge içinde risksiz yönde hareketi ile DAX endeksi **%2'den fazla** değer kazanmıştır.

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

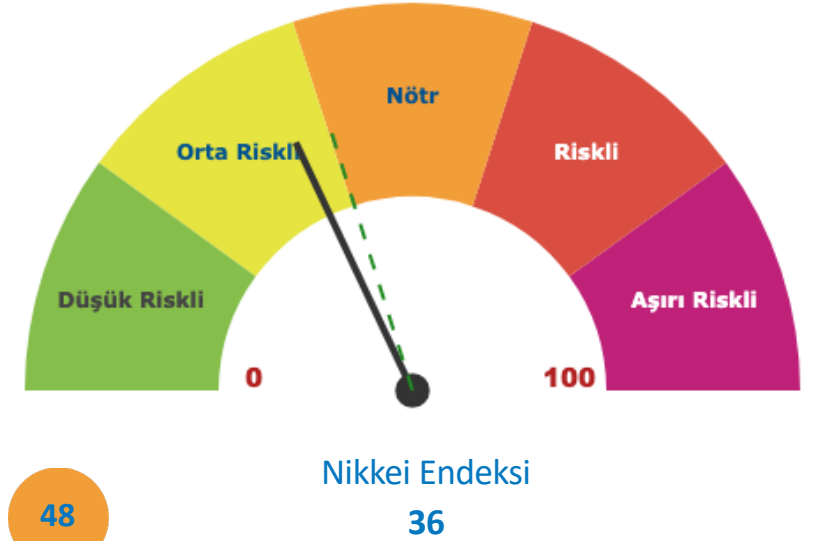


NIKKEI

Nikkei modeli son 1 aydır pozitif yönde ilerliyor.

Son 1 haftalık ve 1 aylık dönemde modelin risksiz yönde ilerlemesiyle Nikkei Endeksinde haftalık **%3**, aylık ise **%5'in üzerinde** getiri sağlanmıştır.

Bu hafta **36** Bir hafta önce **40** Bir ay önce **48**

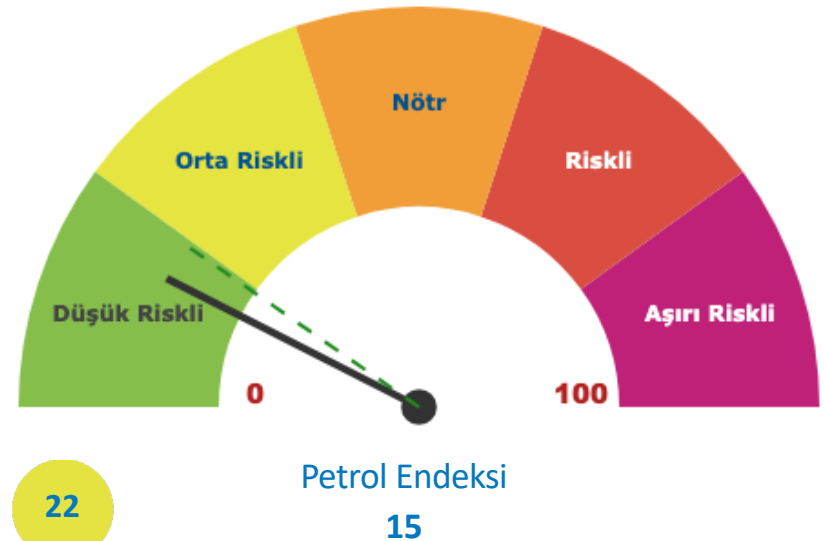


PETROL

Petrol modeli geçtiğimiz aydan beri pozitif yönde ilerliyor.

Modelin son 1 hafta içinde **risksiz** yönde ilerlemesiyle Petrol fiyatları yaklaşık **%5** değer kazanırken, son 1 aylık dönemde ise Petrol fiyatları yaklaşık **%10** değerlenmiştir.

Bu hafta **15** Bir hafta önce **19** Bir ay önce **22**



RİSKOMETRE

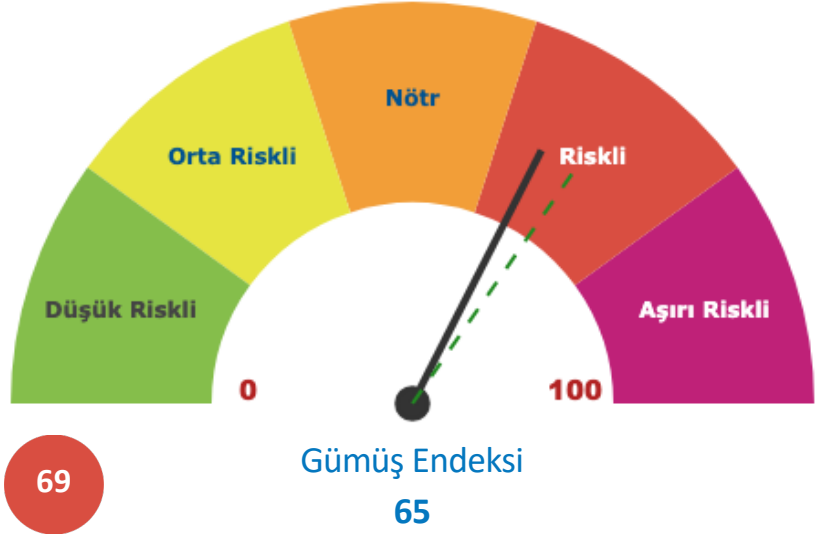
GÜMÜŞ

18 - 24 Eylül 2023

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

Modelin risksiz yöndeki hareketiyle gümüş fiyatları son 1 haftada yaklaşık **%1 değer** kazanmıştır.

Bu hafta **65** Bir hafta önce **69** Bir ay önce **69**

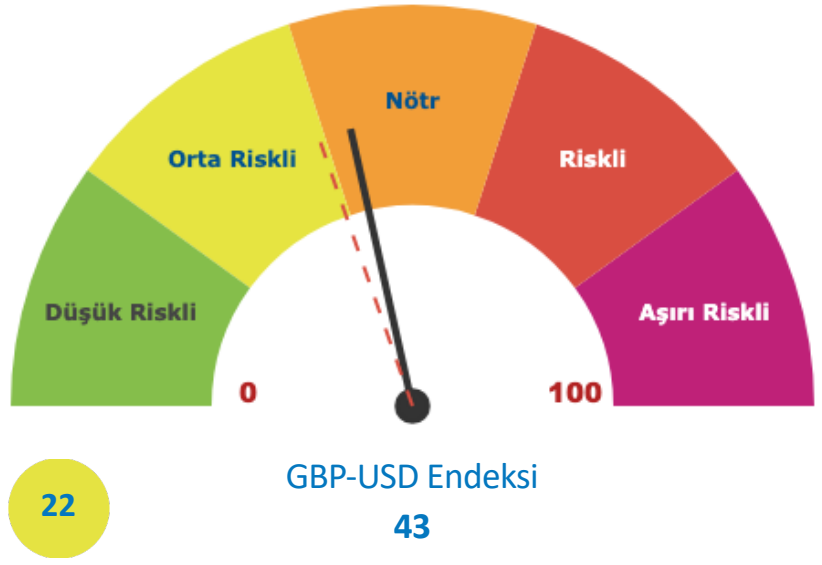


GBPUSD

GBPUSD modeli son 1 haftalık dönemde orta riskli bölgeden **nötr** bölge yönünde hareket etmiştir.

Modelin son 1 haftalık dönemde riskli yöndeki hareketi ile GBPUSD paritesi yaklaşık **%1 değer** kaybetmiştir.

Bu hafta **43** Bir hafta önce **39** Bir ay önce **22**

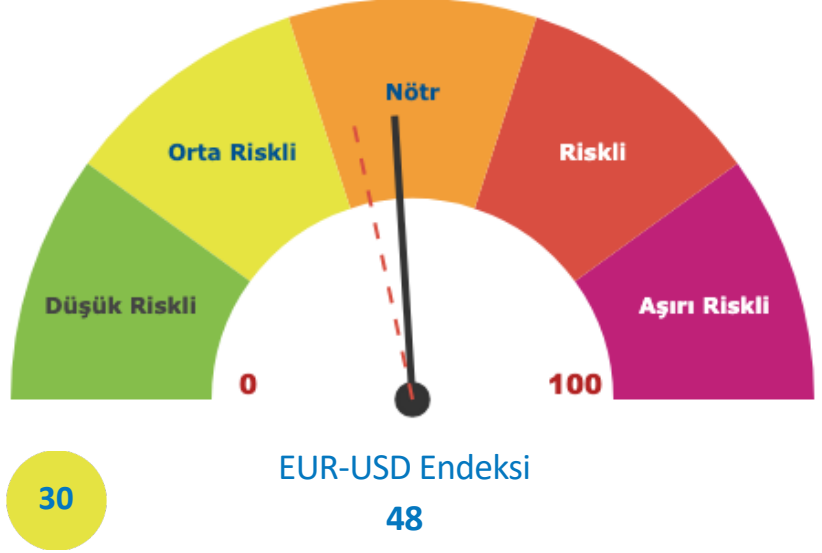


EURUSD

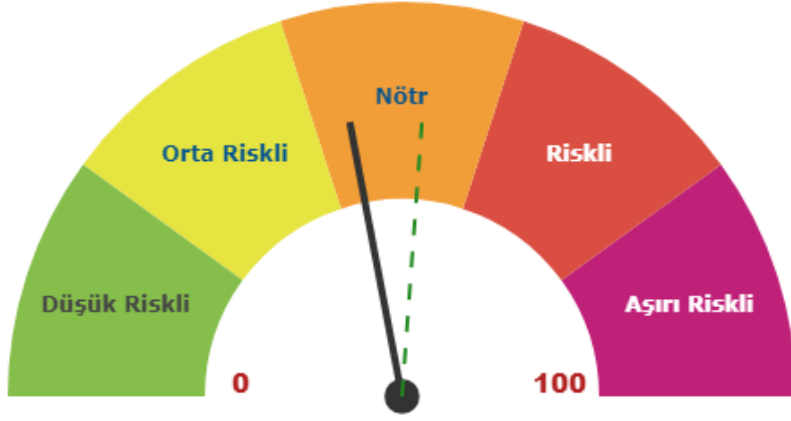
EURUSD modeli son 1 aydır **riskli** yönde ilerlemeye devam ediyor.

Modelin bu süreçte riskli yöne ilerlemesi ile EURUSD paritesinde yaklaşık **%2.1 değer** kaybı yaşanmıştır.

Bu hafta **48** Bir hafta önce **43** Bir ay önce **30**



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."