

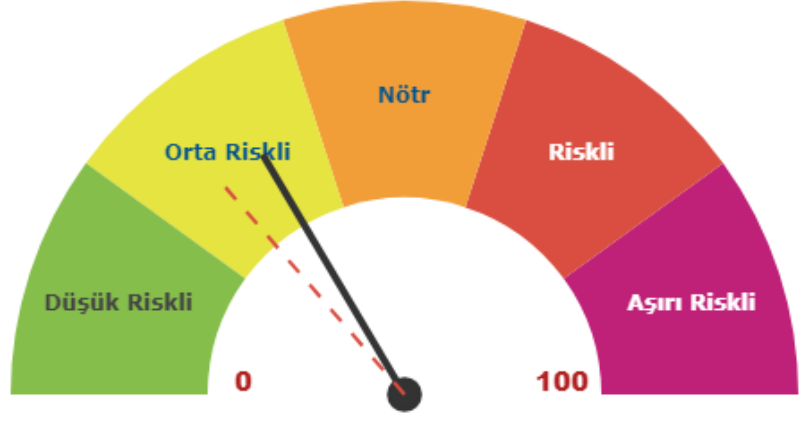
RİSKOMETRE

BIST100

2 - 8 Ekim 2023

BIST100 modeli oynaklığın yüksek olduğu döneme geçiş yapmıştır ve **orta riskli** bölgede bulunmaktadır.

BIST100 Endeksi bir ay önceki seviyelerine kıyasla **%5'lik bir değer artışı** göstermiştir.

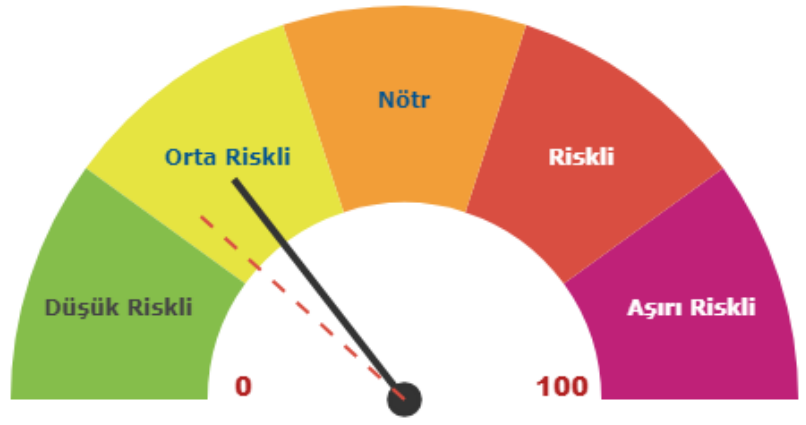


Bu hafta **33** Bir hafta önce **27** Bir ay önce **28**

BIST100 Endeksi
33

BIST30

Geçtiğimiz 1 aylık dönemde ortalamanın üzerinde oynaklık gösterirken BIST30 modeli bu hafta **orta riskli** bölgede yer almaktadır.



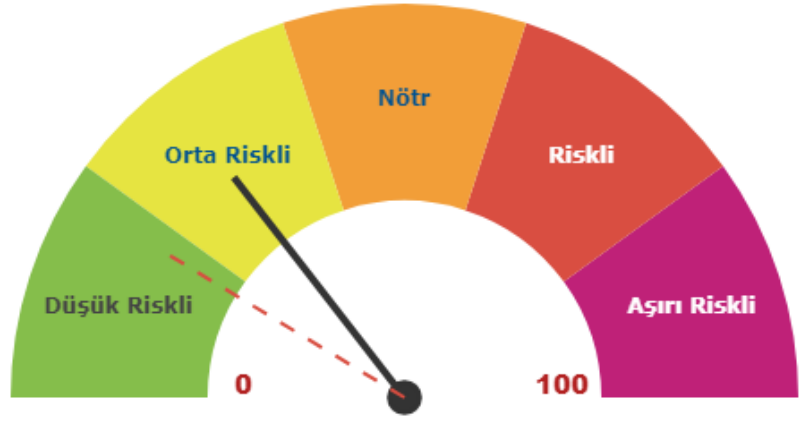
Bu hafta **29** Bir hafta önce **23** Bir ay önce **16**

BIST30 Endeksi
29

BIST BANKACILIK

BIST Bankacılık modeli 1 aylık dönemde düşük riskli bölgeyi test etmiş ve bu hafta **orta riskli** bölgeye geçiş yapmıştır.

Bu dönemde BIST Bankacılık endeksi yaklaşık **%16 getiri sağlamıştır**.



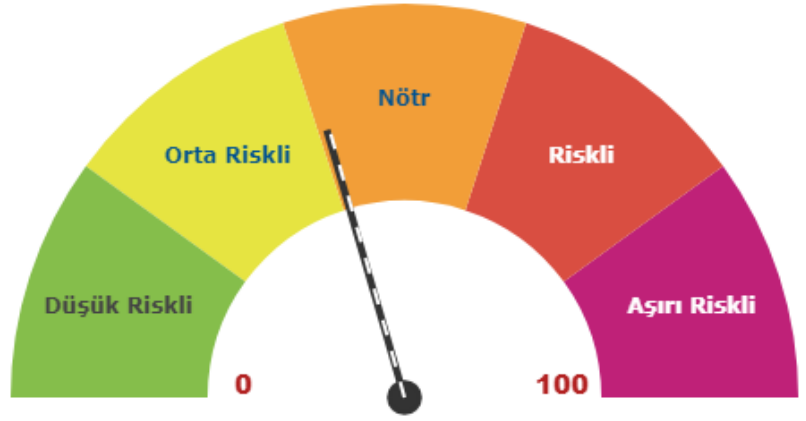
Bu hafta **29** Bir hafta önce **17** Bir ay önce **5**

BIST Bankacılık Endeksi
29

BIST SINAI

1 ay önce orta riskli bölgede yer alan BIST Sınai modeli geçtiğimiz hafta **nötr** bölgeye geçiş yapmış, bu hafta konumunu korumuştur.

Son 1 ayda Sınai endeksi BIST ve diğer alt endekslere göre daha kötü bir performans sergilemiştir.



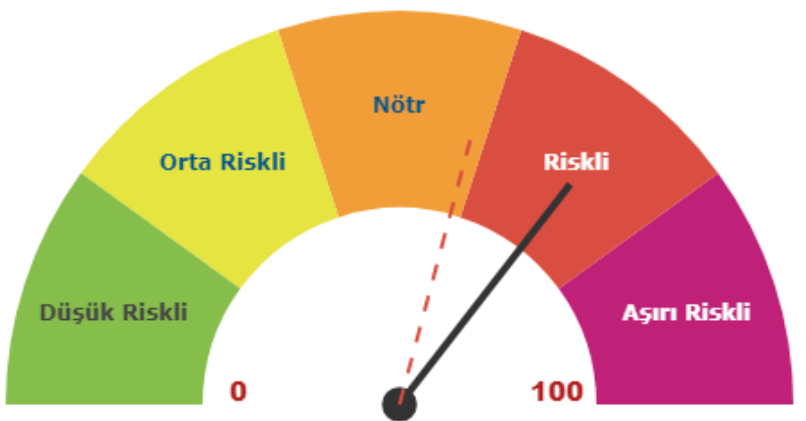
Bu hafta **41** Bir hafta önce **41** Bir ay önce **35**

BIST Sınai Endeksi
41

ALTIN

Altın modeli bulunduğu nötr bölgeden **riskli** bölgeye geçiş yapmıştır.

Model riskli yönde ilerlerken Altın fiyatları 1 haftada yaklaşık **%3**, 1 ayda ise yaklaşık **%3.5 değer kaybetmiştir**.



Bu hafta **71** Bir hafta önce **58** Bir ay önce **55**

Altın Endeksi
71

RİSKOMETRE

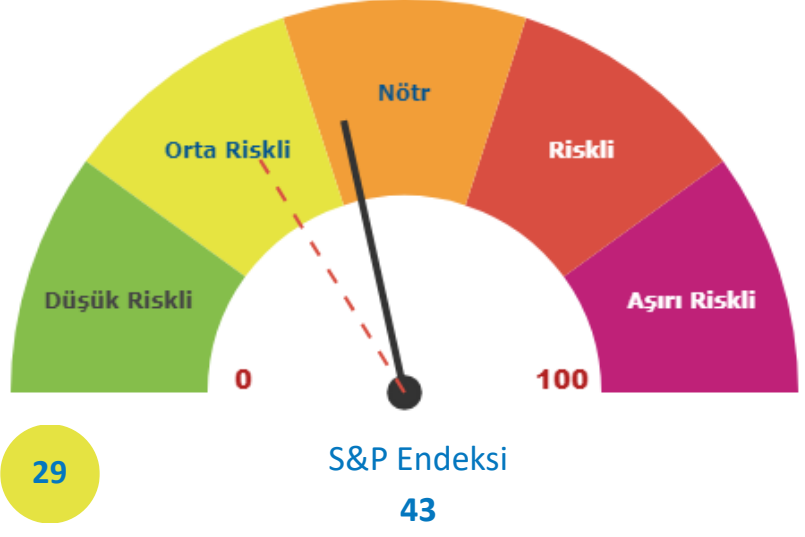
S&P

2 - 8 Ekim 2023

ABD Hisse Senedi modeli 1 aydır bulunduğu orta riskli bölgeden **nötr** bölgeye geçiş yapmıştır.

Modelin 1 haftalık riskli yönde hareketi ile S&P Endeksi yaklaşık **%1 değer kaybederken**, 1 aylık hareketi ile yaklaşık **%5 değer kaybetmiştir**.

Bu hafta **43** Bir hafta önce **32** Bir ay önce **29**

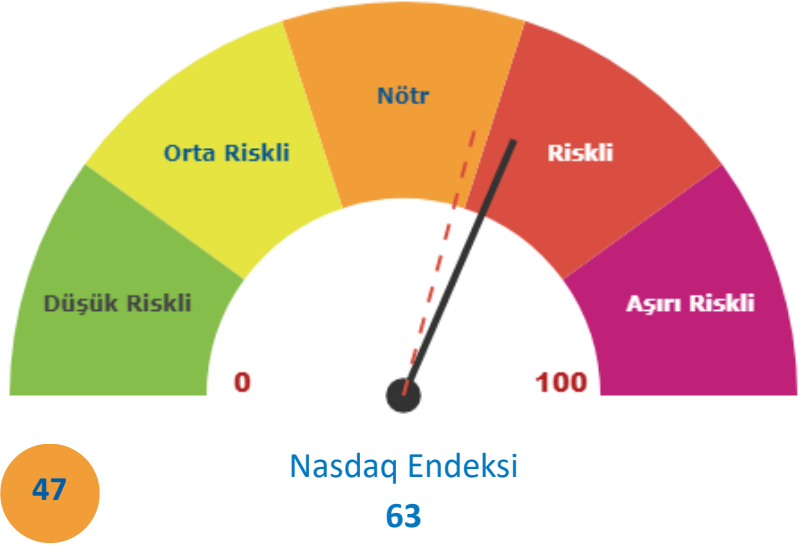


NASDAQ

Nasdaq modeli bu hafta 1 aydır bulunduğu nötr bölgeden **riskli** bölgeye geçiş yapmıştır.

Modelin 1 haftalık riskli yönde hareketi ile Nasdaq Endeksi **%0.5 değer kaybederken**, 1 aylık bölgesel değişimle yaklaşık yüzde **4,5 değer kaybı** yaşamıştır.

Bu hafta **63** Bir hafta önce **58** Bir ay önce **47**

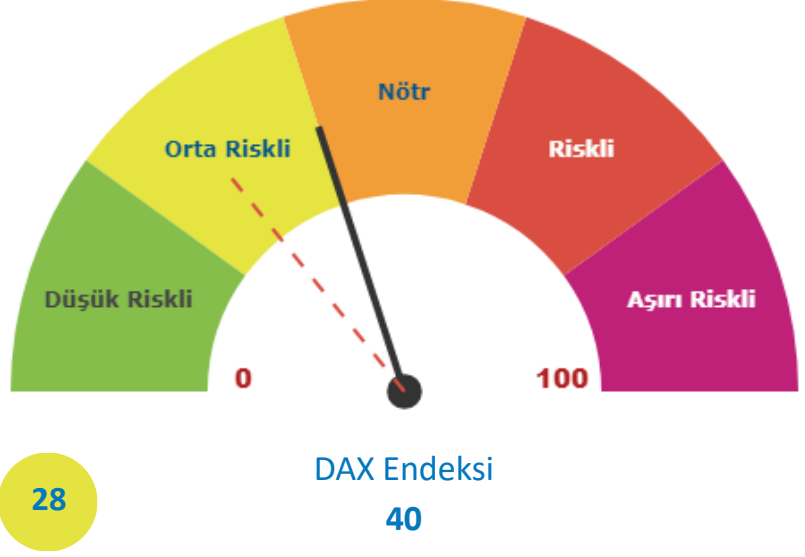


DAX

Alman Hisse Senedi modeli son 1 ayda **orta riskli** bölge içinde riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin 1 aylık riskli yöndeki hareketi ile DAX endeksi yaklaşık **%5 değer kaybetmiştir**.

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

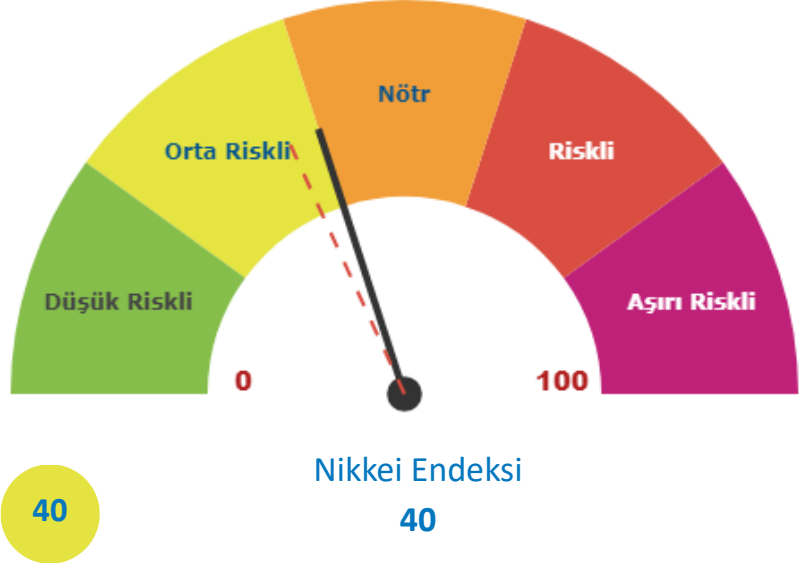


NIKKEI

Nikkei modeli 1 aylık dönemde **orta riskli bölge** içinde dalgalı hareketini sürdürüyor.

Modelin 1 haftalık riskli yönde hareketi ile Nikkei Endeksi yaklaşık **%2 değer kaybetmiştir**.

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

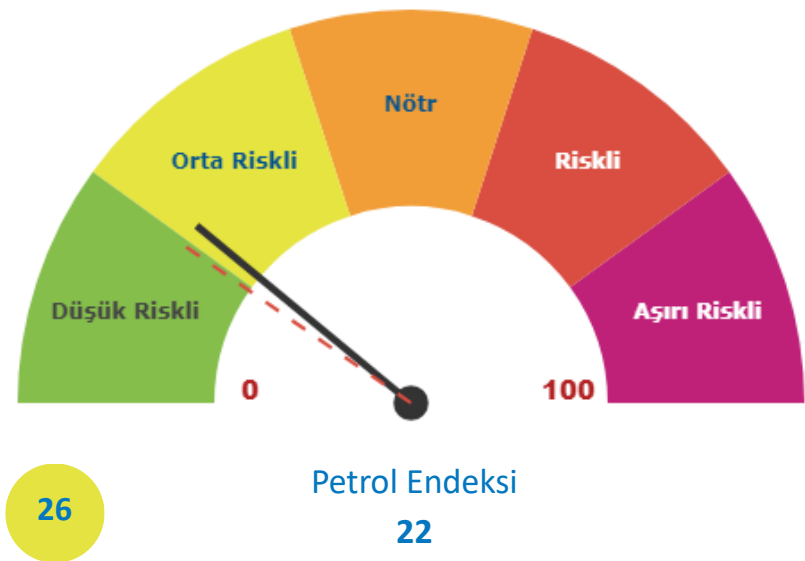


PETROL

Geçtiğimiz hafta düşük riskli bölgede yer alan Petrol modeli **orta riskli** bölgeye dönüş yapmıştır.

Modelin 1 ayda orta riskli bölge içinde düşük riskli yöne ilerlemesi ile Petrol fiyatları yaklaşık **%10 değer kazanmıştır**.

Bu hafta **22** Bir hafta önce **19** Bir ay önce **26**



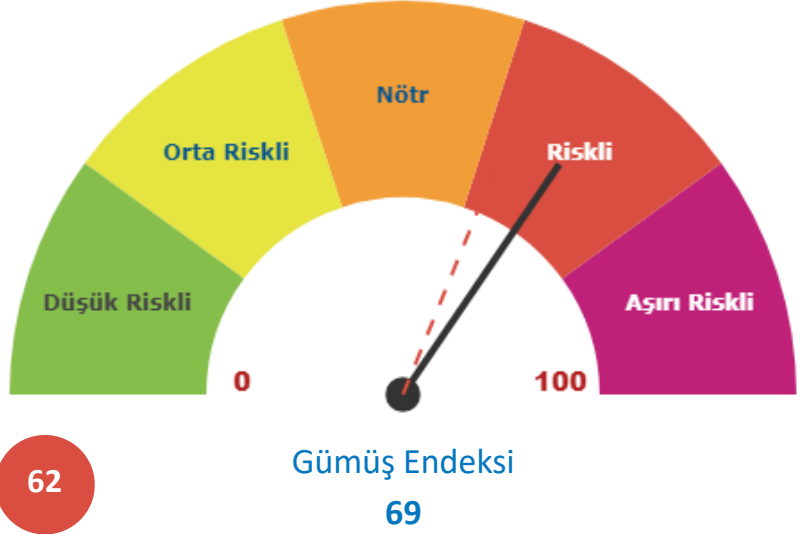
RİSKOMETRE

GÜMÜŞ

2 - 8 Ekim 2023

Gümüş modeli son 1 aydır **riskli bölge** içinde bulunurken 1 haftada aşırı riskli yöne ilerlemeye devam etmiştir.

Modelin 1 haftada riskli yöndeki hareketi ile Gümüş fiyatları yaklaşık **%2.5**, 1 ayda ise yaklaşık **%7 değer kaybetmiştir.**

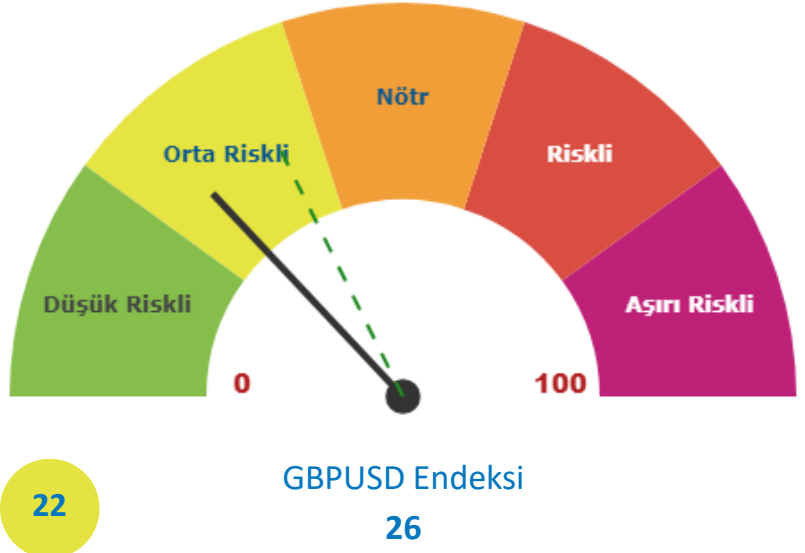


Bu hafta **69** Bir hafta önce **62** Bir ay önce **62**

GBPUSD

GBPUSD modeli son 1 aydır **orta riskli** bölgede yer almaya devam ediyor.

Modelin 1 aylık riskli yöndeki hareketi ile GBPUSD paritesi yaklaşık **%3.5 değer kaybetmiştir.**

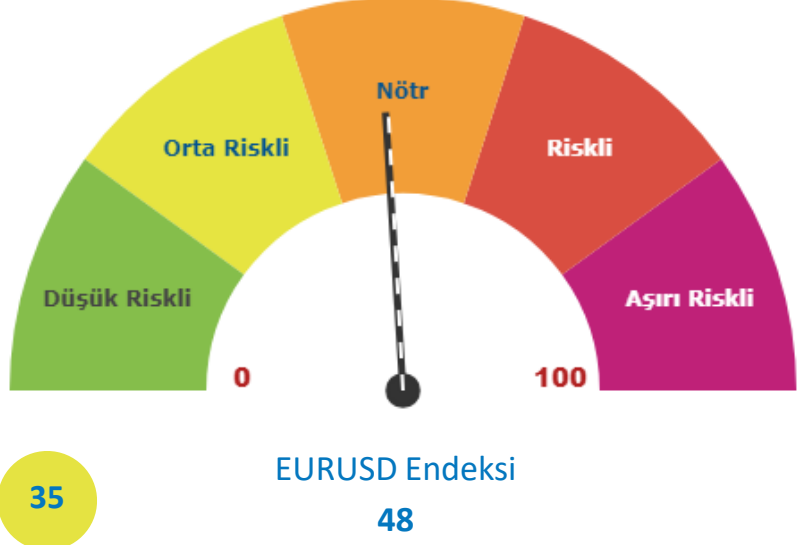


Bu hafta **26** Bir hafta önce **35** Bir ay önce **22**

EURUSD

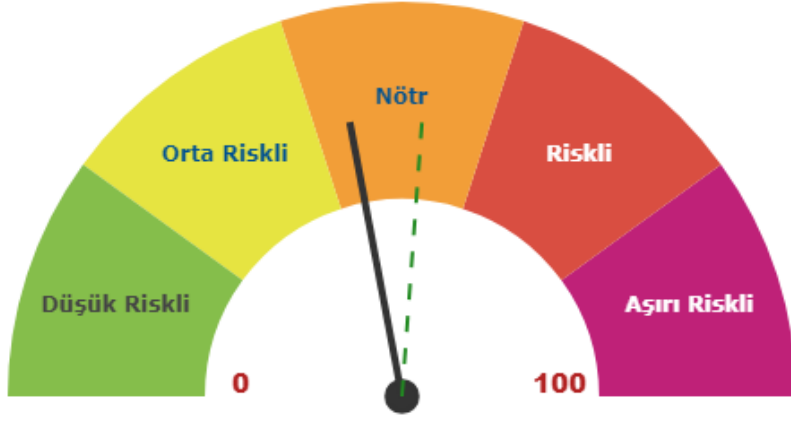
EURUSD modeli 1 aylık dönemde orta riskli bölgeden nötr bölgeye geçiş yaparken 1 haftada konumunu koruyor.

Modelin 1 ayda riskli yöndeki hareketi ile EURUSD paritesinde yaklaşık **%3 değer kaybı** gözlenmiştir.



Bu hafta **48** Bir hafta önce **48** Bir ay önce **35**

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."