

# RİSKOMETRE

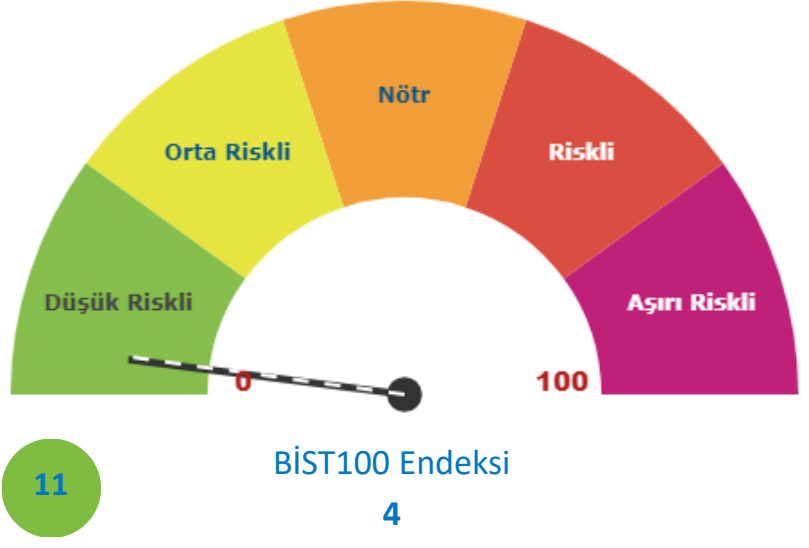
## BİST100

21-27 Ağustos 2023

BİST100 modeli 1 haftalık ve 1 aylık dönemde düşük riskli bölgede kalmaya devam ediyor.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 aylık süreçte BİST100 Endeksi **%21 değer** kazanmıştır.

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

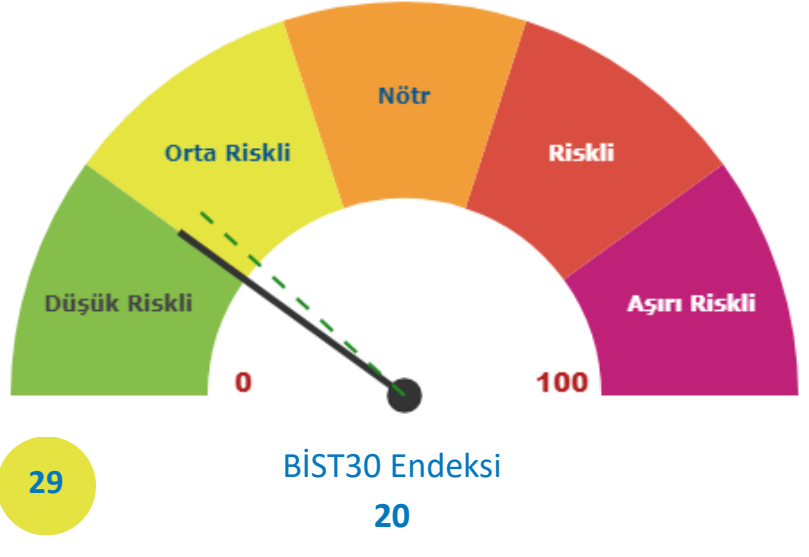


## BİST30

BİST30 modeli 1 haftalık ve 1 aylık dönemde risksiz yöne ilerlerken 1 haftada orta riskli bölgeden **düşük riskli** bölgeye geçiş yapmıştır.

BİST30 Endeksi modelin 1 haftalık hareketi süresince **%2**, 1 aylık dönemde ise **%19 değer** kazanmıştır.

Bu hafta **20** Bir hafta önce **23** Bir ay önce **29**

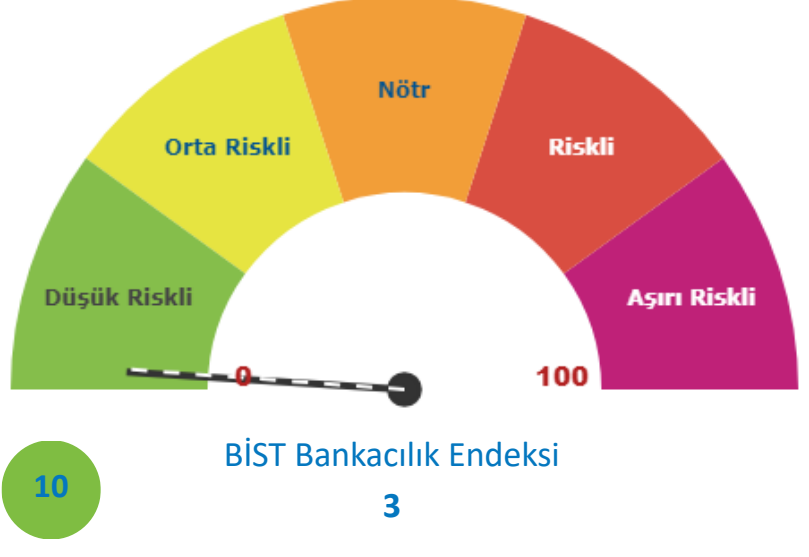


## BİST BANKACILIK

BİST Bankacılık modeli 1 haftalık ve 1 aylık dönemde **düşük riskli** bölgede konumunu koruyor.

Modelin konumu 1 haftada stabil kalırken, 1 ayda risksiz yöndeki hareketi sırasında BİST Bankacılık endeksi **%28 getiri** sağlamıştır.

Bu hafta **3** Bir hafta önce **3** Bir ay önce **10**

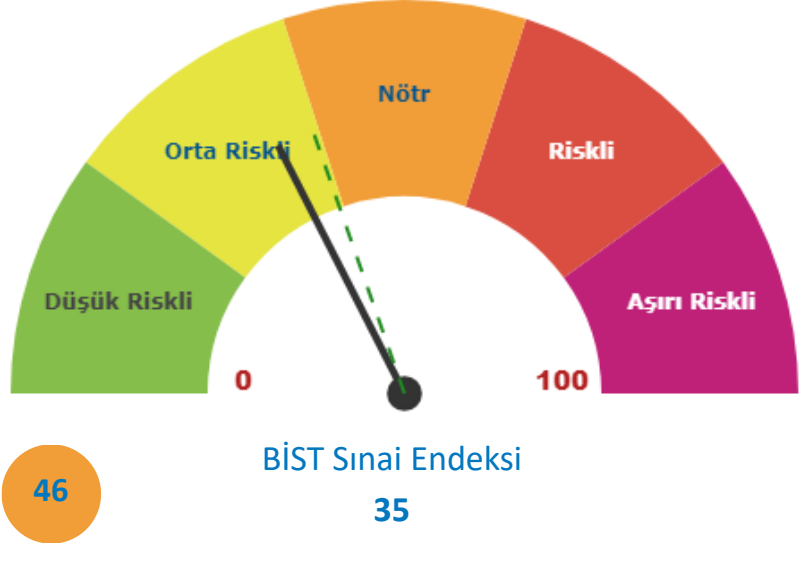


## BİST SINAI

BİST Sınai modeli 1 haftada **orta riskli** bölge içinde risksiz yöne ilerlerken BİST Sınai endeksinde **%3.5 getiri** gözlenmiştir.

Modelin 1 aylık süreçte nötr bölgede orta riskli bölgeye geçişi ile aynı dönemde BİST Sınai endeksi **%21 getiri** sağlamıştır.

Bu hafta **35** Bir hafta önce **39** Bir ay önce **46**

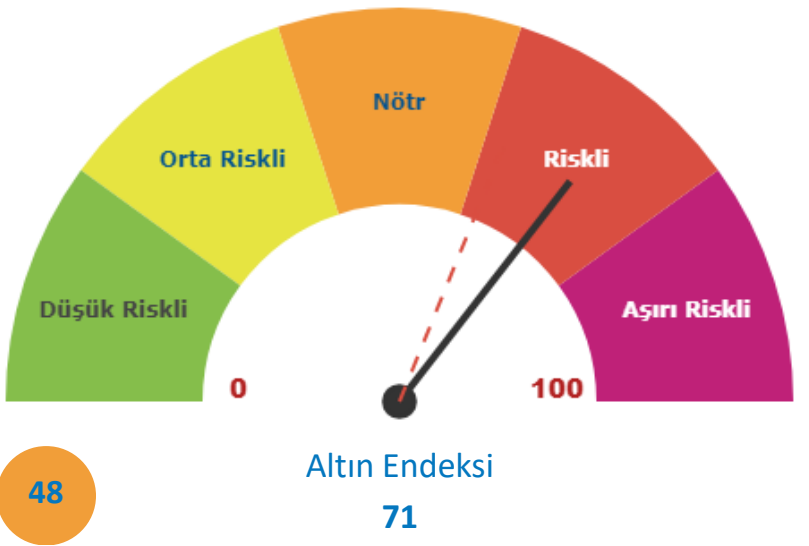


## ALTIN

Altın modeli son 1 ayda nötr bölgeden **riskli** bölgeye geçiş yaparken riskli yönde ilerlemeye devam ediyor.

Modelin 1 haftada riskli yönde ilerleyişi ile aynı dönemde Altın fiyatlarında **%1**, 1 ayda ise yaklaşık **%4 değer kaybı** gözlenmiştir.

Bu hafta **71** Bir hafta önce **62** Bir ay önce **48**



# RİSKOMETRE

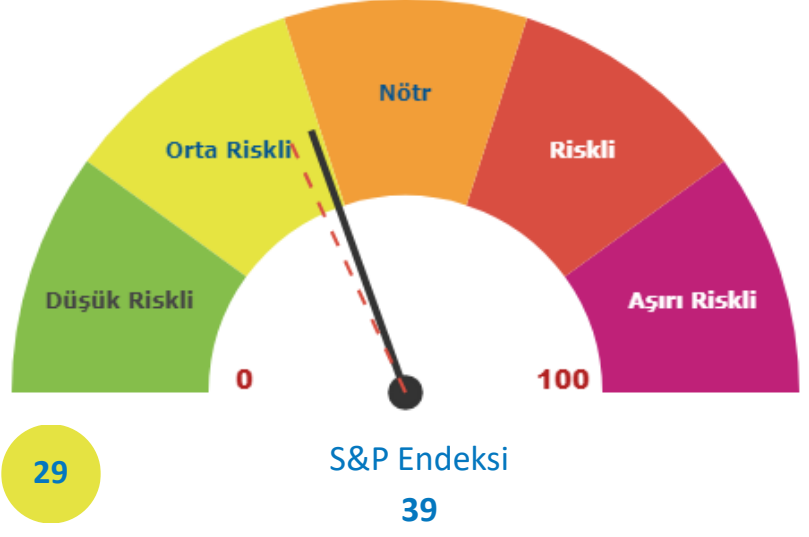
S&P

21-27 Ağustos 2023

ABD Hisse Senedi modeli 1 haftalık ve 1 aylık dönemde **orta riskli** bölge içinde riskli bölge sınırına ilerlemiştir.

Model riskli yönde hareket ederken S&P Endeksi 1 haftada **%2 değer kaybı**, 1 aylık dönemde ise **%4 değer kaybı** yaşamıştır.

Bu hafta **39** Bir hafta önce **36** Bir ay önce **29**

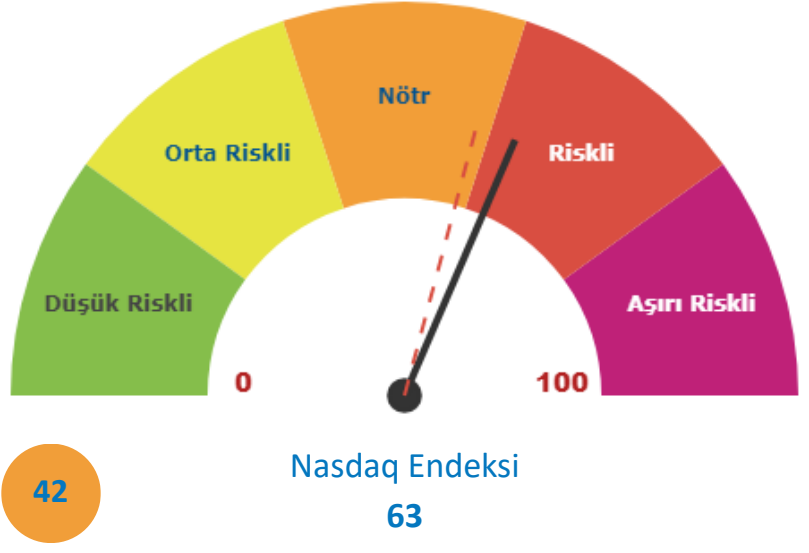


## NASDAQ

Son 1 ayda nötr bölge içinde yer alan NASDAQ modeli, 1 haftalık dönemde **riskli** bölgeye geçiş yapmıştır.

Modelin son 1 haftada bölge geçişi sırasında Nasdaq Endeksinde yaklaşık **%3.5**, 1 aylık dönemde ise **%6 değer kaybı** gözlenmiştir.

Bu hafta **63** Bir hafta önce **58** Bir ay önce **42**

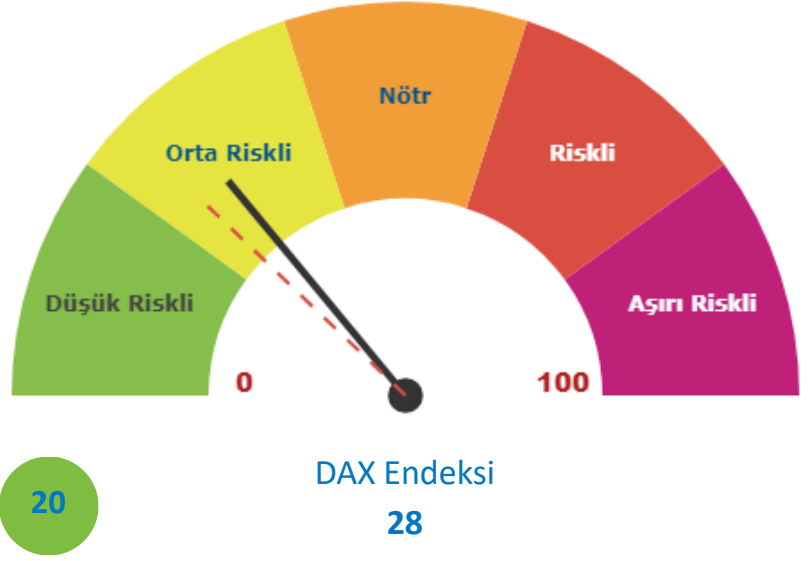


## DAX

1 aylık dönemde düşük riskli bölgeden **orta riskli** bölgeye geçiş yapan Alman Hisse Senedi modeli riskli yönde ilerlemeye devam ediyor.

Modelin 1 haftalık riskli yönde hareketi sırasında DAX Endeksi **%2.5**, 1 aylık bölge değişimi sırasında ise yaklaşık **%3.5 değer** kaybetmiştir.

Bu hafta **28** Bir hafta önce **24** Bir ay önce **20**

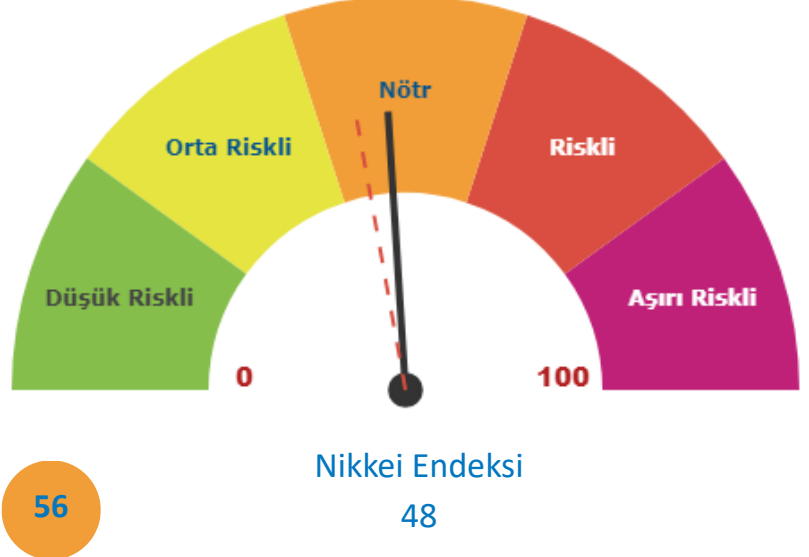


## NIKKEI

Japonya Hisse Senedi modeli son 1 haftalık ve 1 aylık dönemde **nötr** bölge içinde kalmaya devam ediyor.

Modelin 1 haftada riskli yönde hareketi sırasında Nikkei Endeksinde **%3 değer kaybı** gözlenmiştir.

Bu hafta **48** Bir hafta önce **44** Bir ay önce **56**

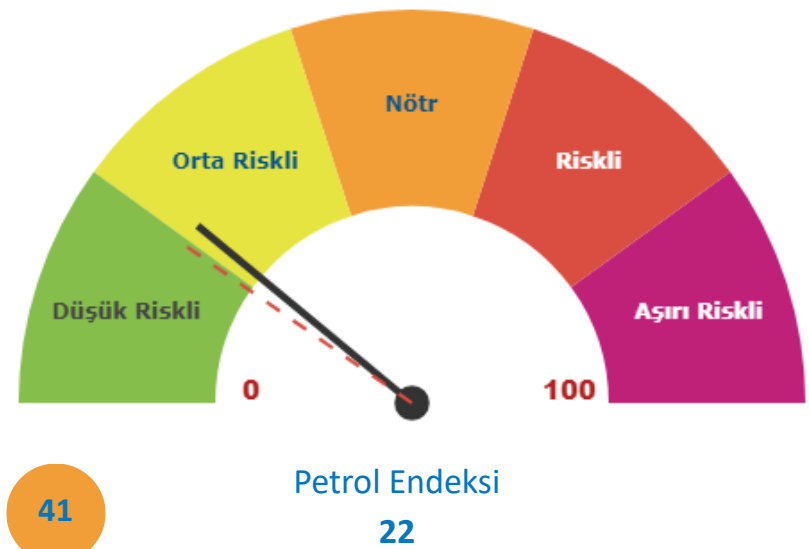


## PETROL

Petrol modeli 1 aylık dönemde dalgalı bir görünüm sunarken, 1 hafta içinde **orta riskli** bölgeye geçiş yapmıştır.

Modelin 1 haftalık bölge değişimi sırasında petrol fiyatları **%3 değer kaybederken**, 1 ayda yaklaşık **%6 getiri** sağlamıştır.

Bu hafta **22** Bir hafta önce **19** Bir ay önce **41**



# RİSKOMETRE

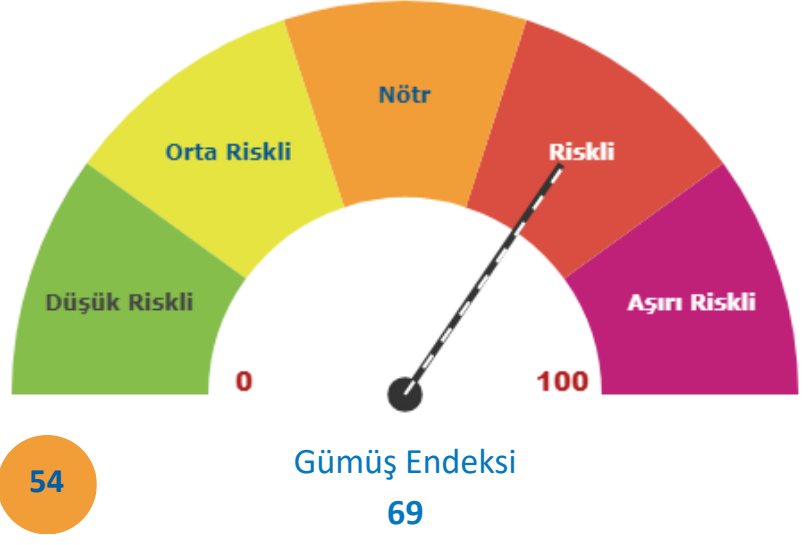
## GÜMÜŞ

21-27 Ağustos 2023

Gümüş modeli 1 aylık dönemde riskli yöne ilerlerken bu hafta **riskli** bölge içinde stabil kalmıştır.

Modelin 1 aylık riskli yöne ilerleyişi ile aynı süreçte Gümüş fiyatları **%8 değer kaybı** yaşamıştır.

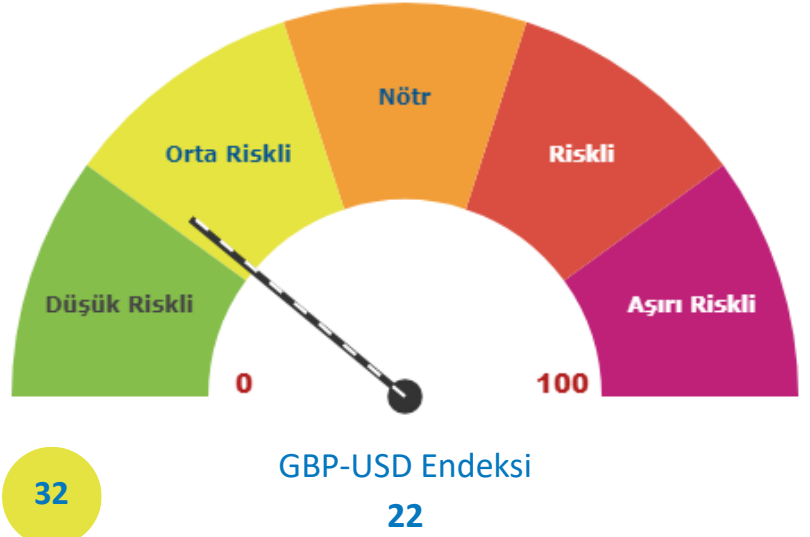
Bu hafta **69** Bir hafta önce **69** Bir ay önce **54**



## GBP-USD

GBP-USD modeli 1 haftalık dönemde **orta riskli** bölge içindeki stabil kalırken GBP-USD paritesinde **%0.5 getiri** gözlenmiştir.

Bu hafta **22** Bir hafta önce **22** Bir ay önce **32**

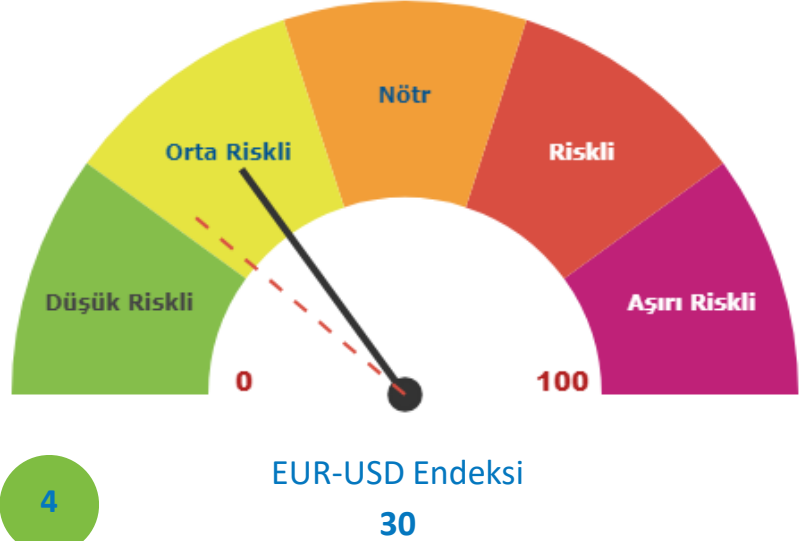


## EUR-USD

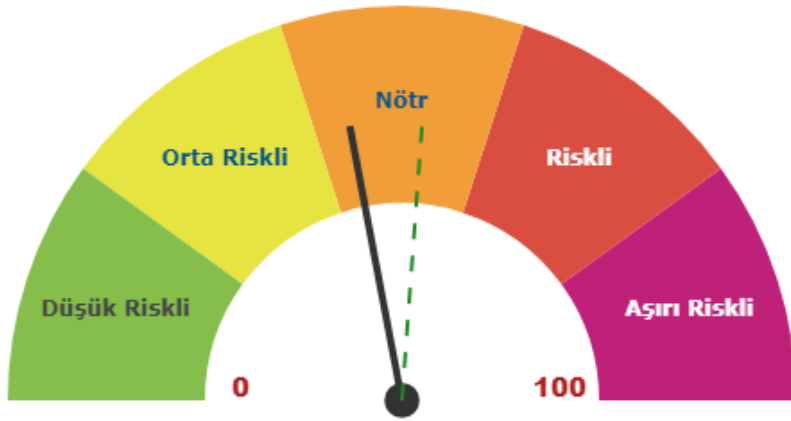
EURUSD modeli 1 haftalık dönemde **orta riskli** bölge içinde riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin 1 aylık dönemde düşük riskli bölgeden orta riskli bölgeye geçişi sırasında EUR-USD paritesi yaklaşık **%3.5 değer kaybı** yaşamıştır.

Bu hafta **30** Bir hafta önce **22** Bir ay önce **4**



## 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](http://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."