

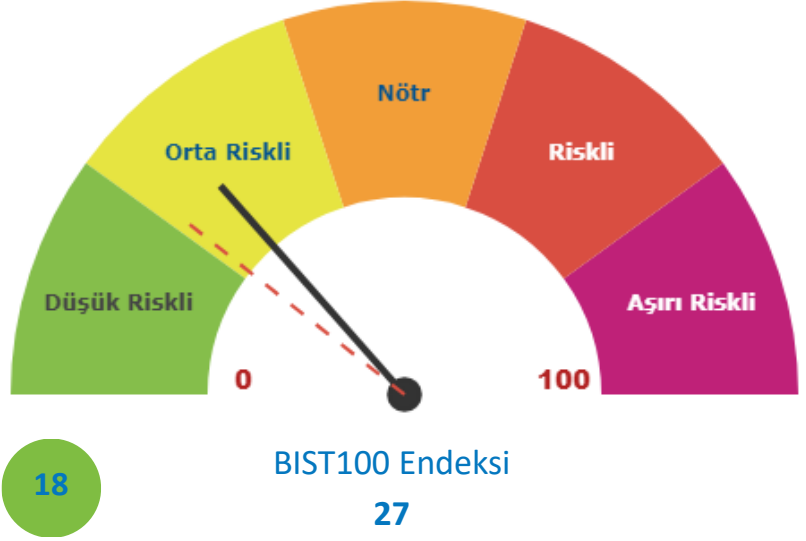
# RİSKOMETRE

## BIST100

25 Eylül - 1 Ekim 2023

BIST100 modeli 1 haftada **orta riskli bölge** içinde riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin riskli yöndeki hareketi ile BIST100 Endeksi yaklaşık **%1.5 değer** kaybetmiştir.

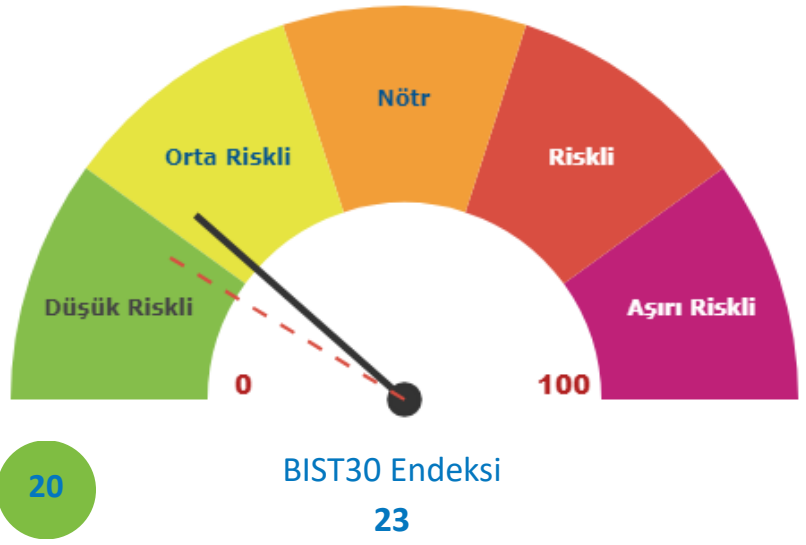


Bu hafta **27** Bir hafta önce **21** Bir ay önce **18**

## BIST30

BIST30 modeli son 1 haftalık dönemde düşük riskli bölgeden **orta riskli bölgeye** geçiş yapmıştır.

Modelin riskli yöndeki hareketi ile BIST30 Endeksi yaklaşık **%2 değer** kaybetmiştir.

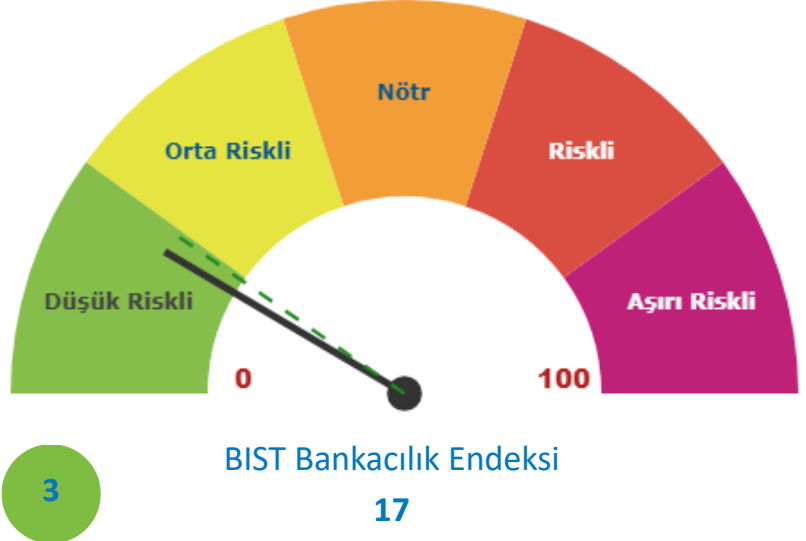


Bu hafta **23** Bir hafta önce **17** Bir ay önce **20**

## BIST BANKACILIK

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

Aynı dönemde BIST Bankacılık endeksi yaklaşık **%6 getiri sağlamıştır.**

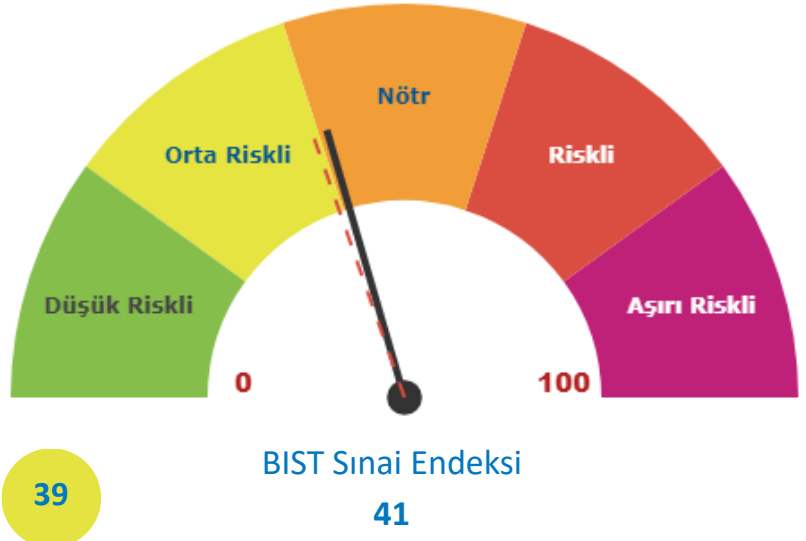


Bu hafta **17** Bir hafta önce **19** Bir ay önce **3**

## BIST SINAI

BIST Sınai modeli orta riskli bölgeden nötr bölgeye geçiş yapmıştır.

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

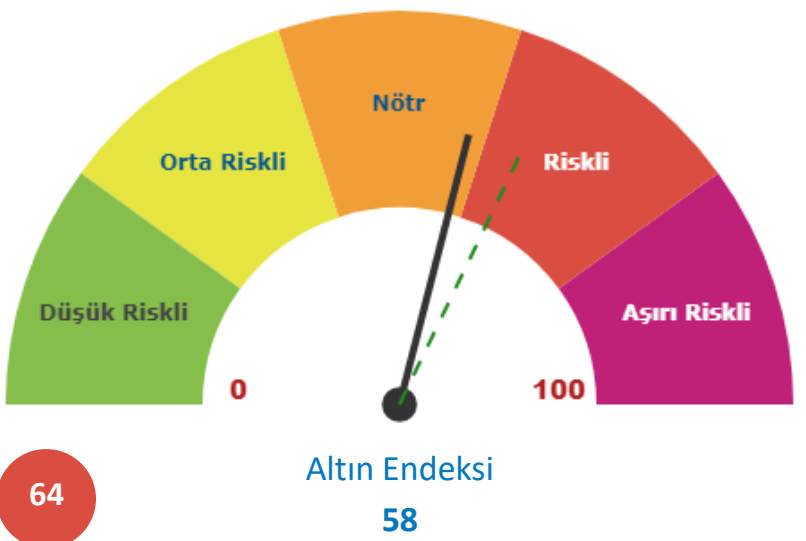


Bu hafta **41** Bir hafta önce **39** Bir ay önce **39**

## ALTIN

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

Modelin düşük riskli yöndeki hareketi ile altın fiyatları yaklaşık **%2 değer kazanmıştır.**



Bu hafta **58** Bir hafta önce **64** Bir ay önce **64**

# RİSKOMETRE

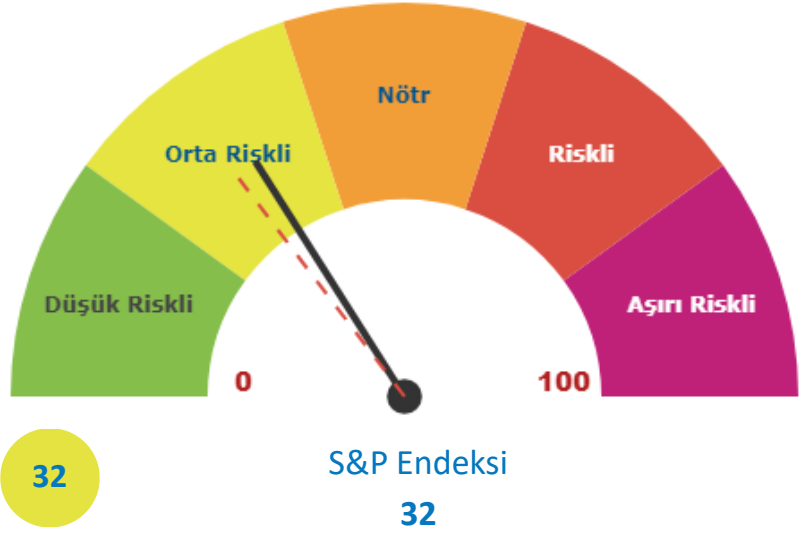
S&P

25 Eylül - 1 Ekim 2023

ABD Hisse Senedi modeli son 1 aylık dönemde **orta riskli** bölge içinde stabil kalırken, 1 haftalık dönemde aynı bölgede riskli yönde ilerlemiştir.

Modelin 1 haftalık riskli yönde hareketi ile S&P Endeksi **%2.70 değer kaybı** yaşamıştır.

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

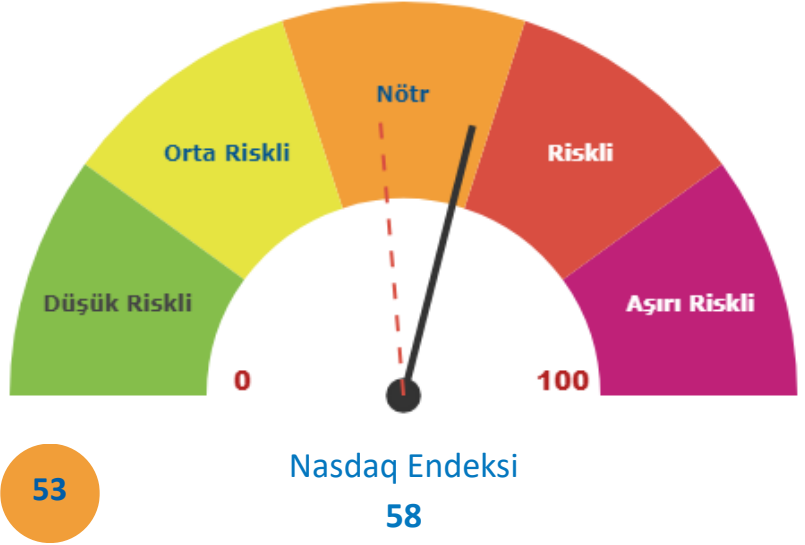


## NASDAQ

Nasdaq modeli son 1 haftada **nötr** bölge içinde riskli yöne ilerlerken Nasdaq Endeksi yaklaşık **%3.5 değer kaybı** yaşamıştır.

Modelin 1 aylık riskli yöndeki hareketi sırasında ise endekste **%3 değer kaybı** gözlenmiştir.

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

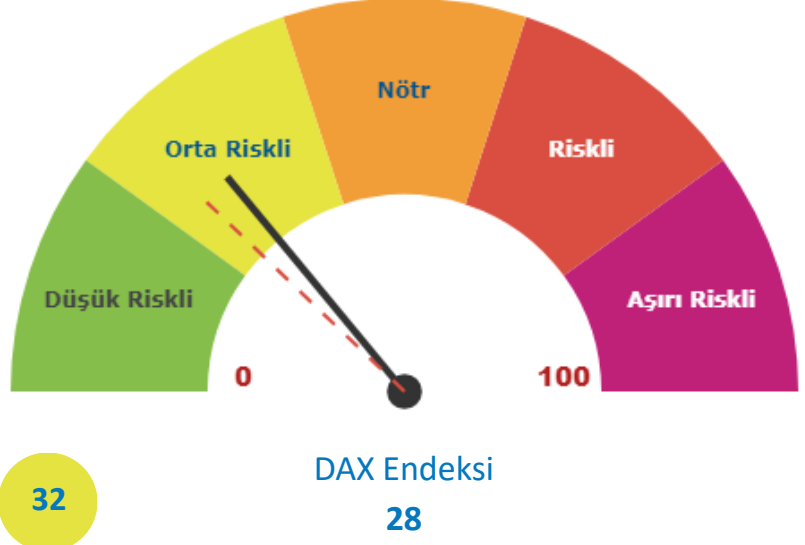


## DAX

Alman Hisse Senedi son 1 ayda **orta riskli** bölge içinde dalgalı hareketini sürdürüyor.

Modelin 1 haftalık riskli yönde hareketi ile DAX endeksi **%2.5 değer kaybetmiştir**.

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

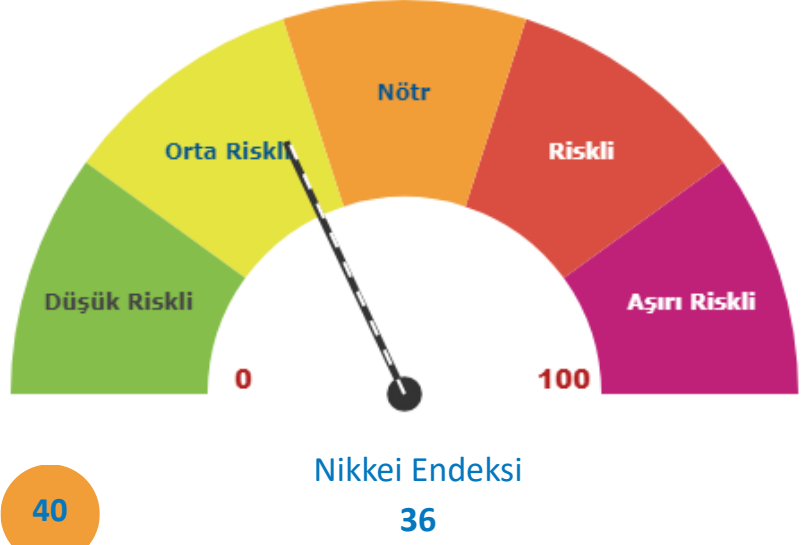


## NIKKEI

Nikkei modeli 1 aylık dönemde düşük riskli yönde ilerlerken bu hafta **orta riskli bölge** içinde konumunu koruyor.

Modelin 1 aylık düşük riskli yöndeki hareketi ile Nikkei Endeksi yaklaşık **%2 değer kazanmıştır**.

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

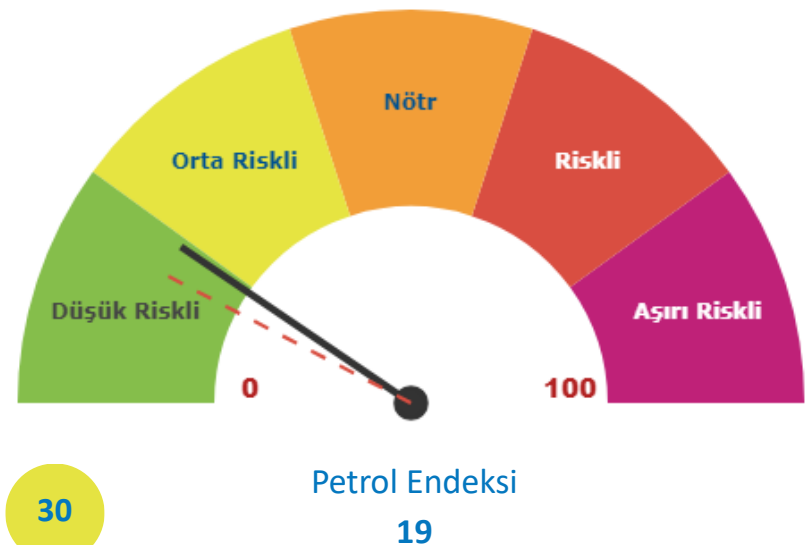


## PETROL

Petrol modeli 1 haftada **düşük riskli bölge** içinde orta riskli bölge sınırına ilerlemiştir. Modelin bu hareketi ile petrol fiyatları yaklaşık **%1 değer kaybetmiştir**.

Modelin 1 ayda orta riskli bölgeden düşük riskli bölgeye geçişi ile petrol fiyatları **%11 değer kazanmıştır**.

Bu hafta **19** Bir hafta önce **15** Bir ay önce **30**



# RİSKOMETRE

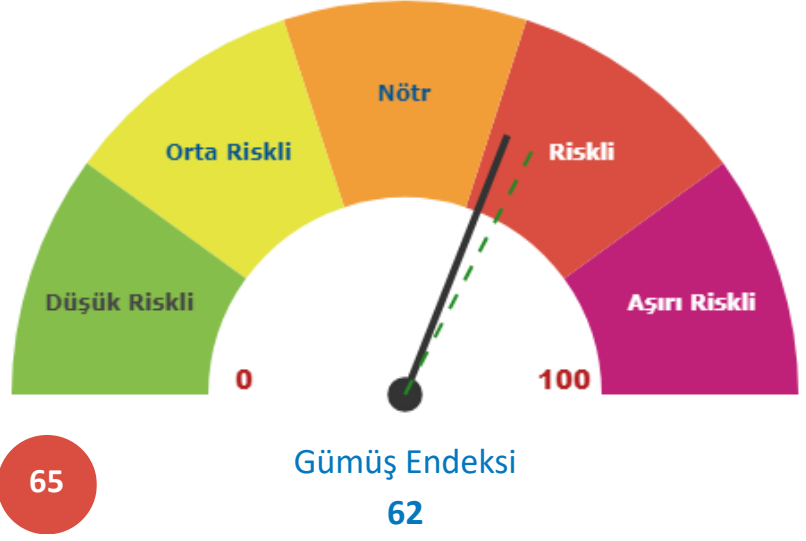
## GÜMÜŞ

25 Eylül - 1 Ekim 2023

Gümüş modeli son 1 aydır bulunduğu **riskli bölge** içinde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin bu düşük riskli yöndeki hareketiyle gümüş fiyatları yaklaşık **%3.30 değer** kazanmıştır.

Bu hafta **62** Bir hafta önce **65** Bir ay önce **65**

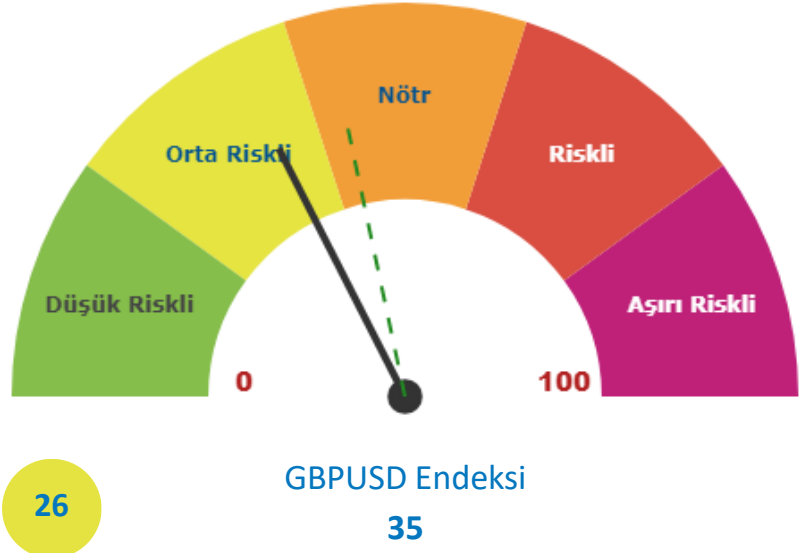


## GBPUSD

GBPUSD modeli son 1 aylık dönemde nötr bölgeyi test edip orta riskli bölgeye dönüş yapmıştır.

Modelin 1 aylık riskli yöndeki hareketi ile GBPUSD paritesi yaklaşık **%4 değer** kaybetmiştir.

Bu hafta **35** Bir hafta önce **43** Bir ay önce **26**

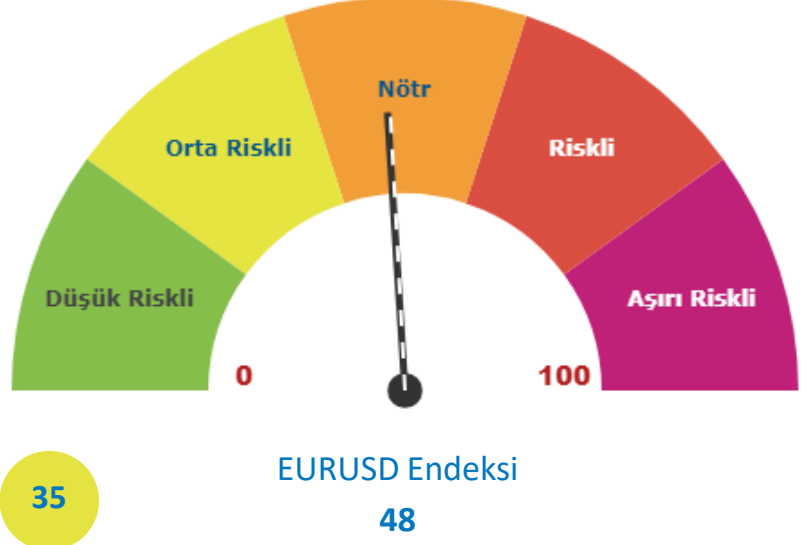


## EURUSD

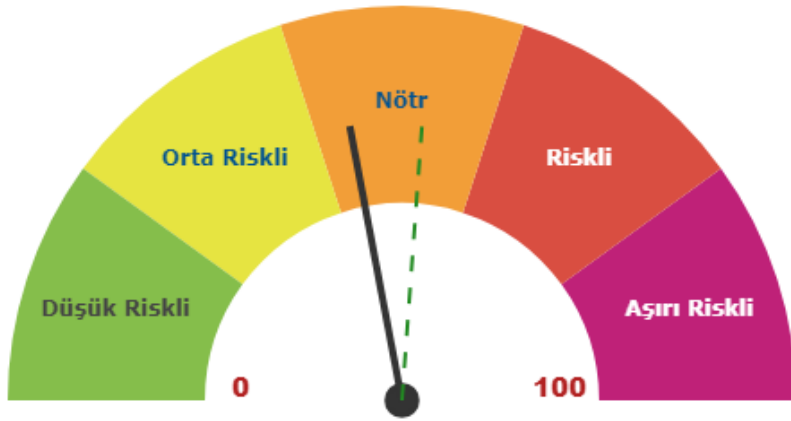
EURUSD modeli 1 haftalık dönemde nötr bölge içinde stabil konumunu koruyor.

Modelin 1 ayda orta riskli bölgeden nötr bölgeye geçişi ile EURUSD paritesinde **%1.80 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](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."