

RİSKOMETRE

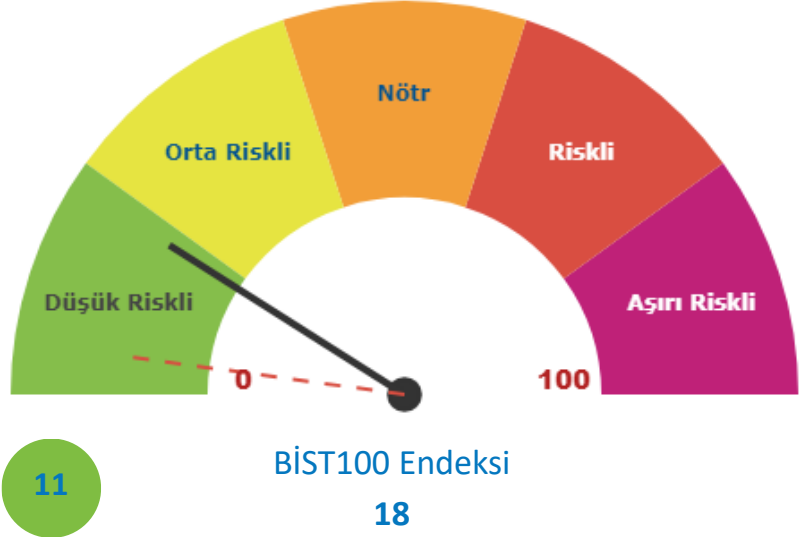
BIST100

28 ağustos - 3 Eylül 2023

Düşük riskli bölgede kalmaya devam eden BIST100 modeli 1 haftada riskli yönde ilerlemiştir.

Modelin bu hareketi süresince 1 haftada BIST100 endeksinde yaklaşık **%2.5 değer kaybı** gözlenmiştir.

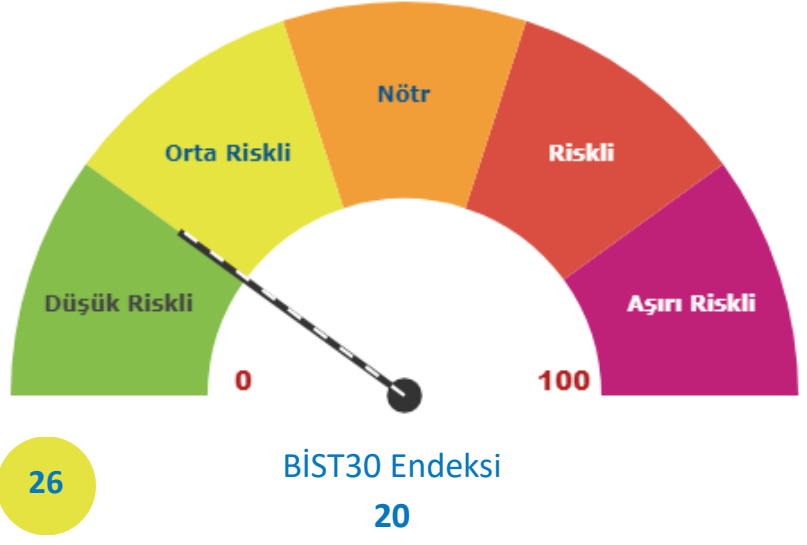
Bu hafta **18** Bir hafta önce **4** Bir ay önce **11**



BIST30

BIST30 modeli 1 haftalık dönemde **düşük riskli** bölge sınırında sabit kalırken, 1 aylık dönemde orta riskli bölgeden düşük riskli bölgeye geçmiş aynı dönemde BIST30 Endeksi yaklaşık **%8 değer kazanmıştır**.

Bu hafta **20** Bir hafta önce **20** Bir ay önce **26**

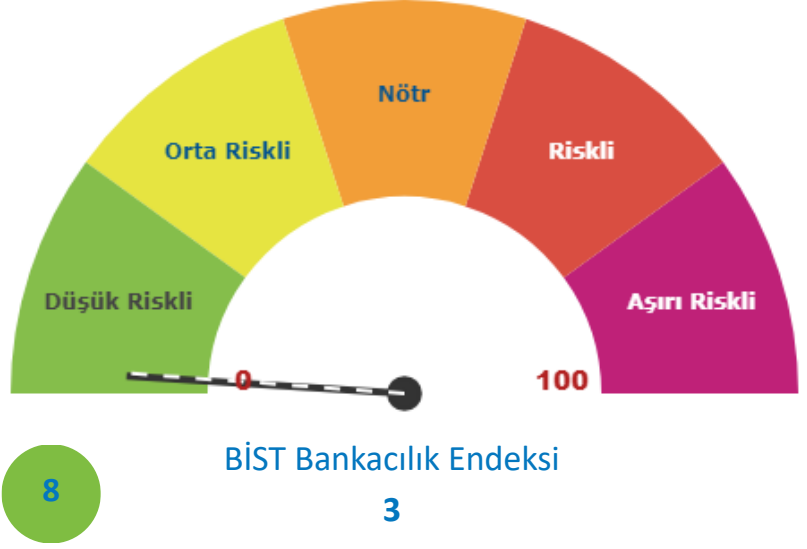


BIST BANKACILIK

BIST Bankacılık modeli 1 haftalık dönemde **düşük riskli** bölge alt sınırında yer almaya devam ediyor.

1 aylık dönemde ise modelin düşük riskli yönde hareketi ile BIST Bankacılık endeksi **%20'nin üzerinde getiri** sağlamıştır.

Bu hafta **3** Bir hafta önce **3** Bir ay önce **8**

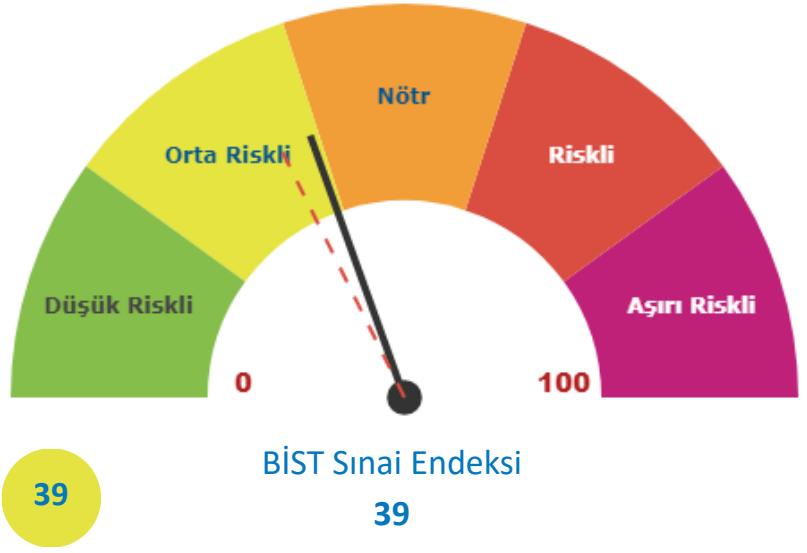


BIST SINAI

BIST Sınai modeli 1 haftada **orta riskli** bölge içinde riskli yöne ilerlemiş, aynı dönemde BIST Sınai Endeksinde **%2 değer kaybı** gözlenmiştir.

Modelin 1 aylık süreçte orta riskli bölgede dalgalı hareketi sırasında BIST Sınai endeksinde **%10'un üzerinde getiri** gözlenmiştir.

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

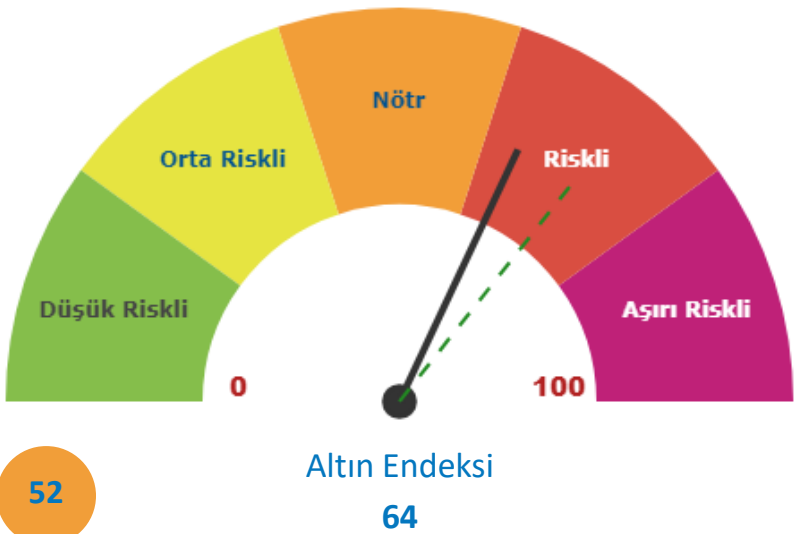


ALTIN

1 haftada riskli bölge içinde **düşük riskli** yönde ilerleyen Altın modeli ile aynı dönemde Altın fiyatları yaklaşık **%1.5 değer kazanmıştır**.

Modelin 1 ayda riskli yönde ilerleyişi ile aynı dönemde Altın fiyatlarında yaklaşık **%2 değer kaybı** gözlenmiştir.

Bu hafta **64** Bir hafta önce **71** Bir ay önce **52**



RİSKOMETRE

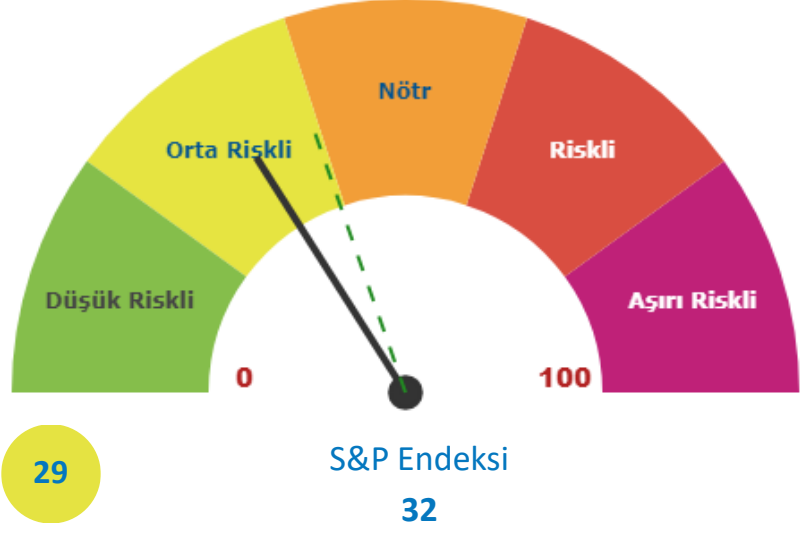
S&P

28 ağustos - 3 Eylül 2023

ABD Hisse Senedi modeli kısa ve uzun vadede **orta riskli** bölgede yer almaya devam ediyor.

Model 1 haftada **düşük riskli** yönde hareket ederken S&P Endeksi **%1.5 değer kazanmış**, 1 aylık dönemde riskli yönde hareket ederken ise **%3.5 değer kaybı** yaşamıştır.

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

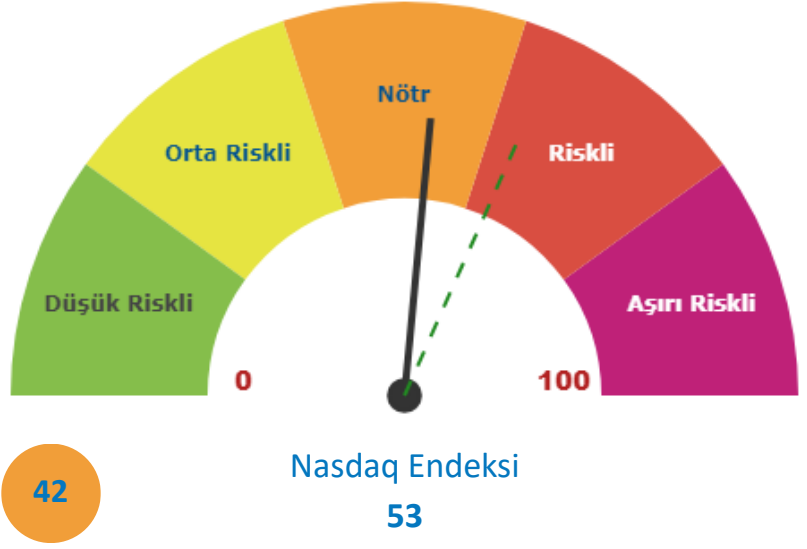


NASDAQ

Nasdaq modeli 1 haftalık dönemde riskli bölgeden **nötr bölgeye** geçiş yaparak 1 ay önceki konumuna yaklaşmıştır.

Modelin son 1 haftada bölge geçişi sırasında Nasdaq Endeksi **%2 değer kazanmış**, 1 aylık dönemde ise **%4'ün üzerinde değer** kaybetmiştir.

Bu hafta **53** Bir hafta önce **63** Bir ay önce **42**

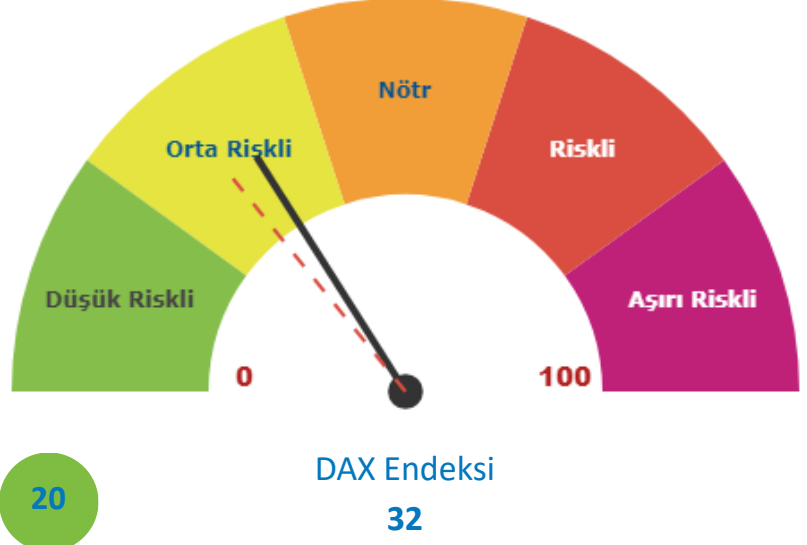


DAX

Alman Hisse Senedi modeli 1 haftada **orta riskli** bölge içinde riskli yöne ilerlemiş aynı dönemde DAX Endeksinde **%0.5 değer kaybı** gözlenmiştir.

Modelin 1 aylık riskli yönde hareketi sırasında DAX Endeksi **yaklaşık %5 değer** kaybetmiştir.

Bu hafta **32** Bir hafta önce **28** Bir ay önce **20**

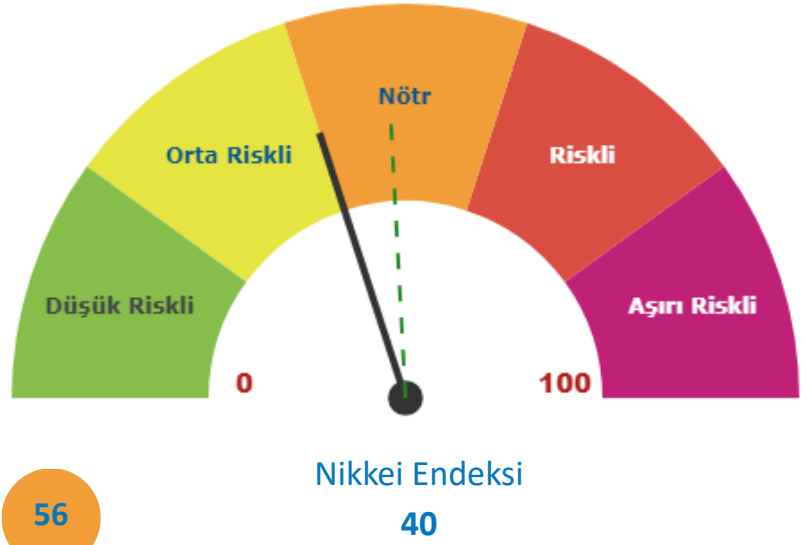


NIKKEI

Uzun süredir nötr bölgede seyreden Japonya Hisse Senedi modeli **orta riskli** bölge sınırına geçiş yapmıştır.

Modelin 1 haftalık hareketi ile aynı dönemde Nikkei Endeksinde **%0.5 getiri** gözlenmiştir.

Bu hafta **40** Bir hafta önce **48** Bir ay önce **56**

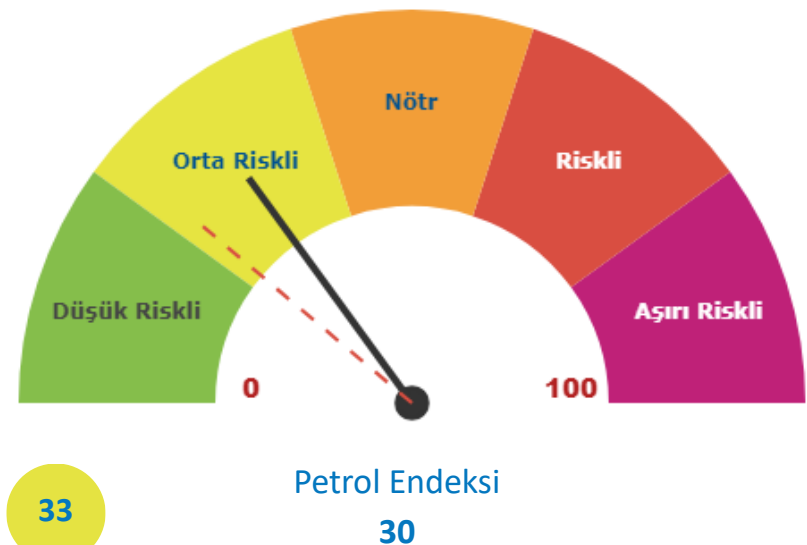


PETROL

Petrol modelinin 1 aylık dönemde **düşük riskli** yönde ilerlemesi ile aynı dönemde petrol fiyatları yaklaşık **%2 değer** kazanmıştır.

Model 1 haftada **orta riskli** bölge içinde riskli yöne ilerlerken aynı dönemde petrol fiyatları **%1.5 değer** kaybetmiştir.

Bu hafta **30** Bir hafta önce **22** Bir ay önce **33**

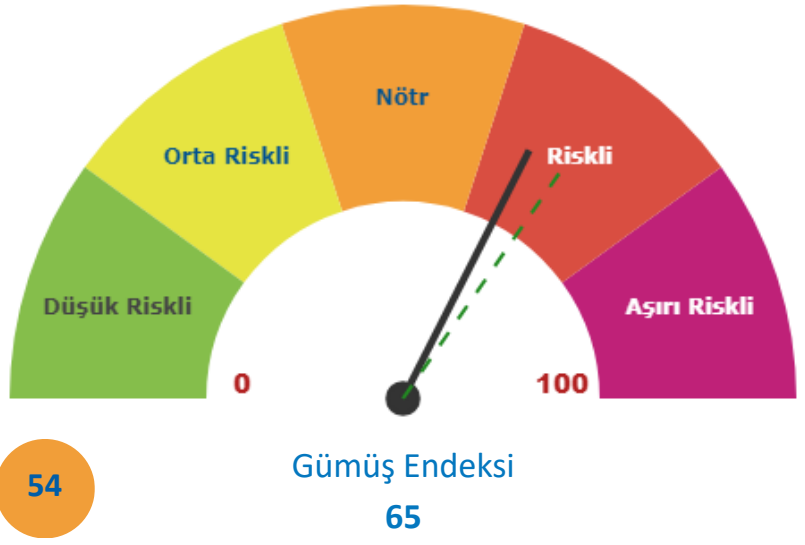


RİSKOMETRE

GÜMÜŞ

28 ağustos - 3 Eylül 2023

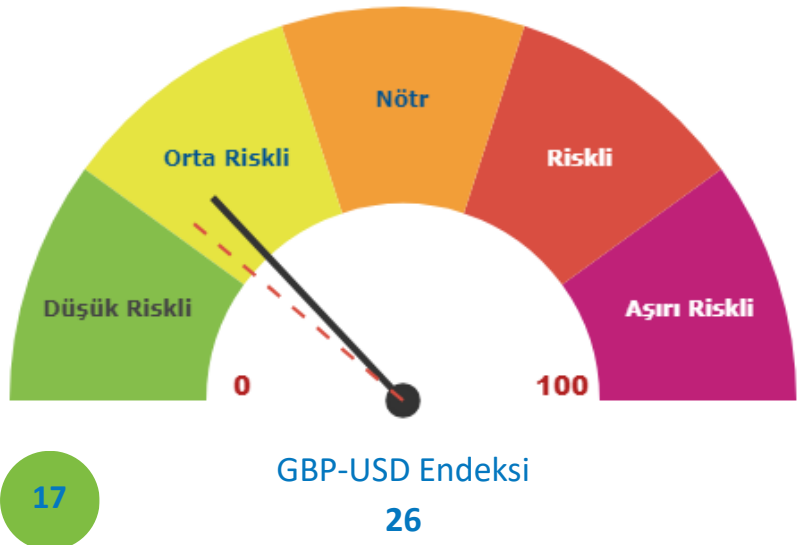
Son 1 ayda dalgalı hareketini sürdüren Gümüş modeli 1 haftalık dönemde **riskli bölge** içinde risksiz yöne ilerlemiştir. Modelin bu hareketi sırasında gümüş fiyatlarında **%5 getiri** gözlenmiştir.



GBPUSD

GBPUSD modeli 1 haftalık dönemde **orta riskli** bölge içinde riskli yöne ilerlemiştir. Aynı dönemde GBPUSD paritesi yaklaşık **%1 değer** kaybetmiştir.

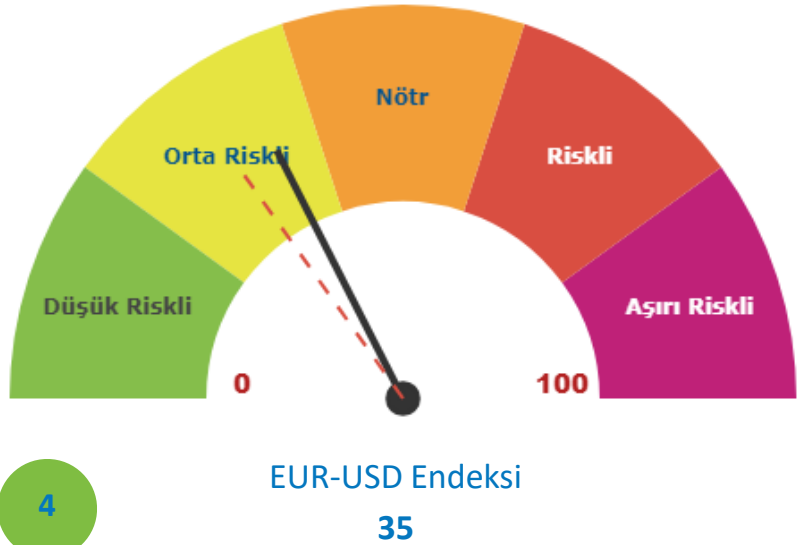
Modelin 1 ayda düşük riskli bölgeden orta riskli bölgeye geçişi sırasında GBPUSD paritesi yaklaşık **%3.5 değer kaybı** yaşamıştır.



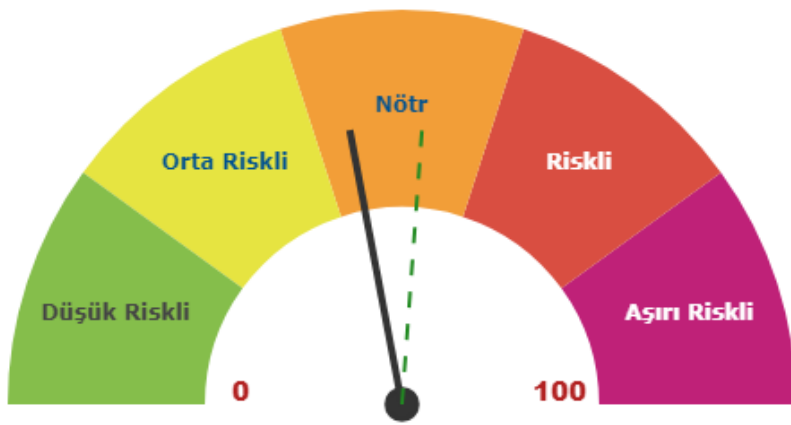
EURUSD

EURUSD modeli 1 haftalık dönemde **orta riskli** bölge içinde riskli yöne ilerlemiş, aynı süreçte EURUSD paritesi yaklaşık **%1 değer** kaybetmiştir.

Model 1 ayda düşük riskli bölgeden orta riskli bölgeye geçerken parite **%2.5 değer kaybı** yaşamıştır.



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."