

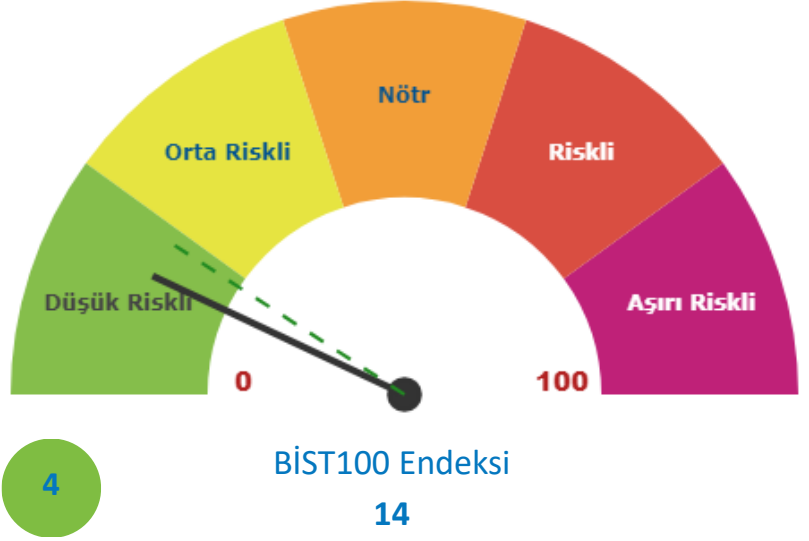
# RİSKOMETRE

## BIST100

4 - 10 Eylül 2023

BIST100 Modeli 1 haftalık dönemde **düşük riskli** bölge içinde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin bu hareketi ile 1 haftada BIST100 endeksi **%5'in üzerinde değer** kazanmıştır.

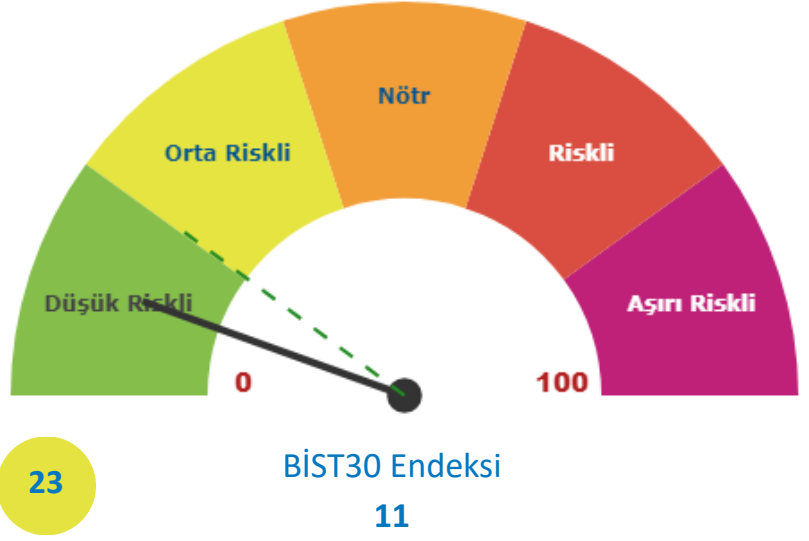


Bu hafta **14** Bir hafta önce **18** Bir ay önce **4**

## BIST30

BIST30 modeli 1 haftalık dönemde **düşük riskli** yönde ilerlerken BIST30 endeksi yaklaşık **%5 getiri** sağlamıştır.

Modelin 1 aylık dönemde ise orta riskli bölgeden düşük riskli bölgeye geçişi sırasında BIST30 Endeksi yaklaşık **%7 değer** kazanmıştır.

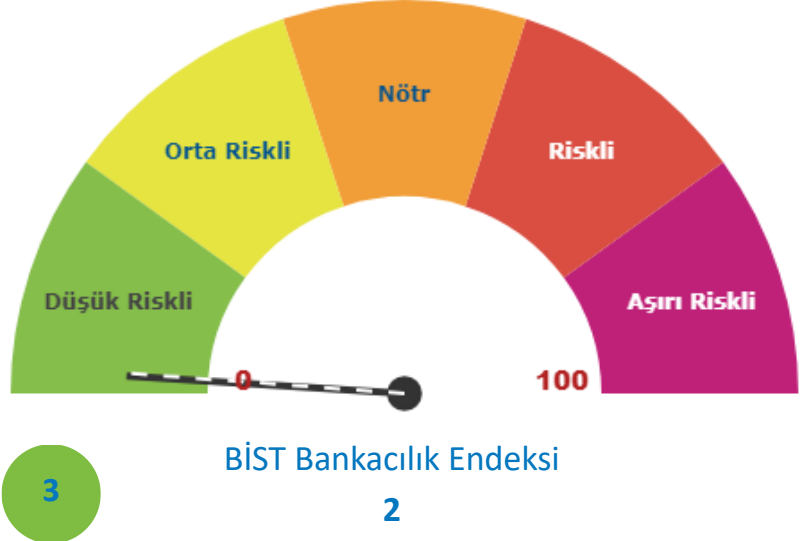


Bu hafta **11** Bir hafta önce **20** Bir ay önce **23**

## BIST BANKACILIK

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

1 aylık dönemde modelin düşük riskli yönde hareketi ile BIST Bankacılık endeksi **%15'in üzerinde getiri** sağlamıştır.

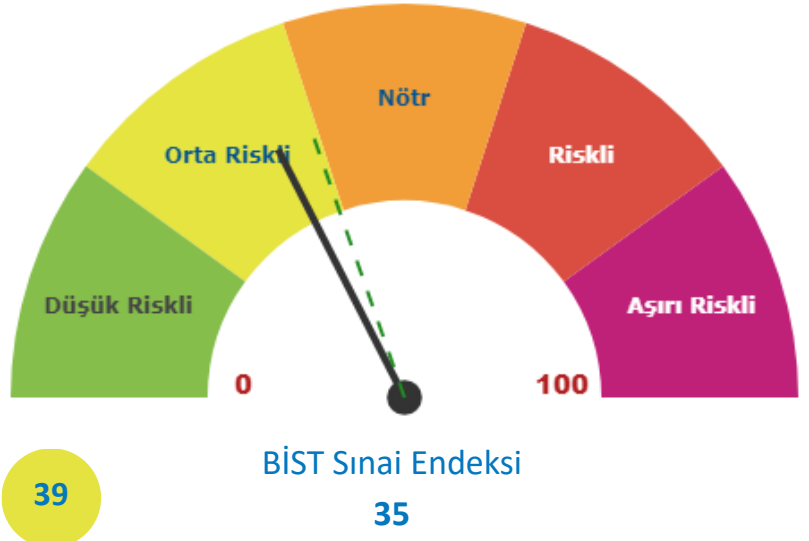


Bu hafta **2** Bir hafta önce **3** Bir ay önce **3**

## BIST SINAI

BIST Sınai modeli 1 haftada **orta riskli** bölge içinde düşük riskli yöne ilerlerken BIST Sınai Endeksi yaklaşık **%8 değer** kazanmıştır.

Modelin 1 ayda düşük riskli yöne hareketi sırasında BIST Sınai endeksi **%13'ün üzerinde getiri** sağlamıştır.

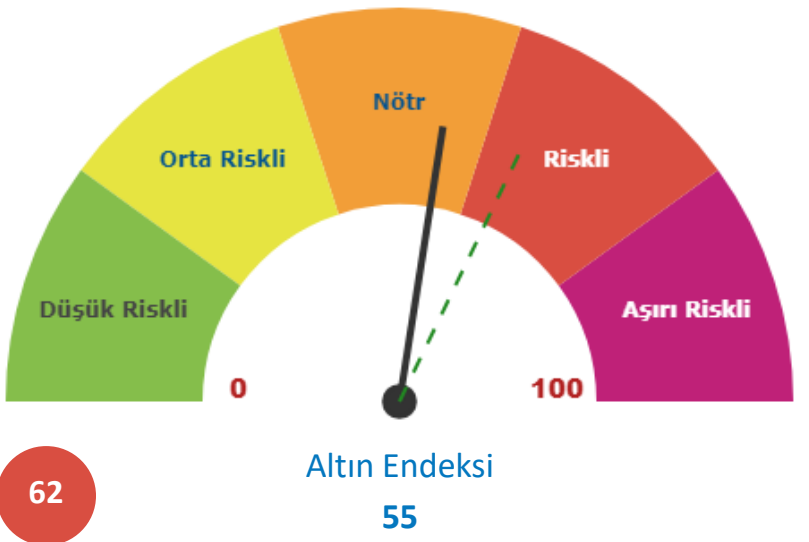


Bu hafta **35** Bir hafta önce **39** Bir ay önce **39**

## ALTIN

1 aylık ve 1 haftalık dönemde düşük riskli yönde ilerleyen Altın Modeli riskli bölgeden **nötr bölgeye** geçiş yapmıştır.

Modelin 1 haftalık hareketi ile Altın fiyatları yaklaşık **%1.5 değer** kazanmıştır.



Bu hafta **55** Bir hafta önce **64** Bir ay önce **62**

# RİSKOMETRE

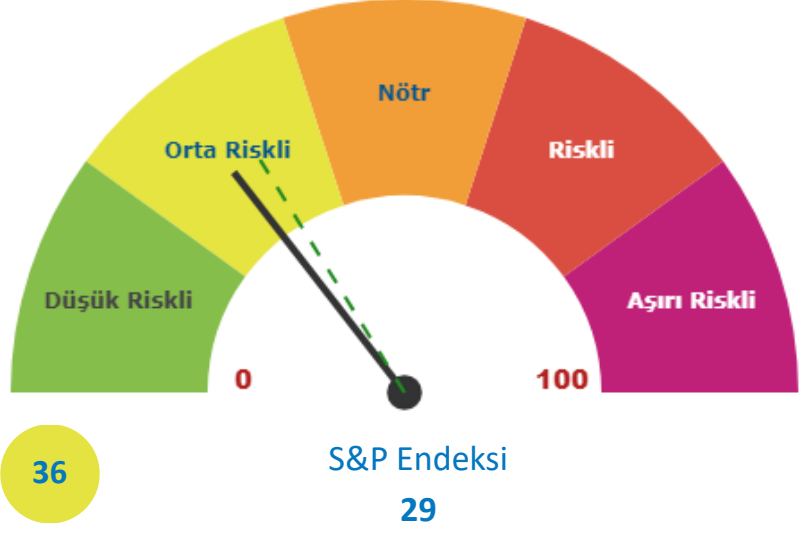
S&P

4 - 10 Eylül 2023

ABD Hisse Senedi modeli 1 haftalık dönemde **orta riskli** bölge içinde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin bu hareketi ile S&P Endeksi yaklaşık **%3 değer** kazanmıştır.

Bu hafta **29** Bir hafta önce **32** Bir ay önce **36**

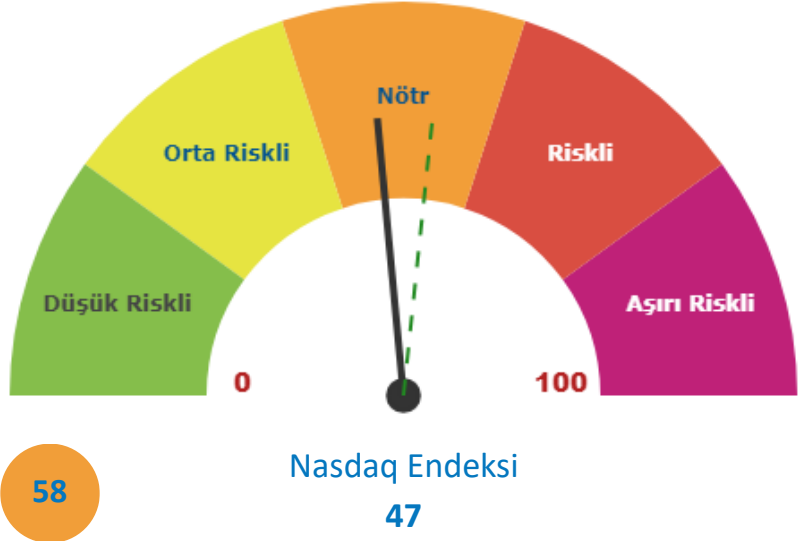


## NASDAQ

Nasdaq modeli 1 haftada **nötr bölge** içinde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin bu hareketi sırasında Nasdaq Endeksi yaklaşık **%4 getiri** sağlamıştır.

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

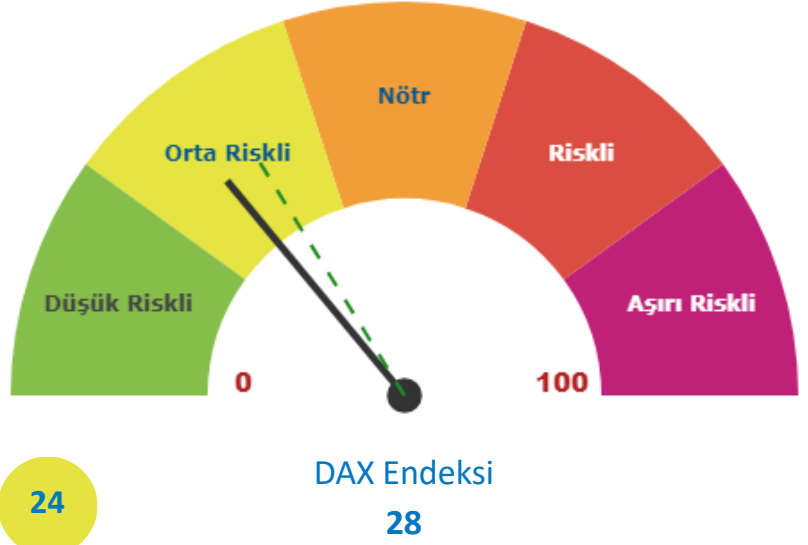


## DAX

Alman Hisse Senedi modeli 1 aylık dönemde **orta riskli** bölge içinde riskli yöne ilerlerken 1 haftada düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin 1 aylık hareketi ile Alman Hisse Senedi Endeksi **%2.5 değer** kaybetmiş, 1 haftada ise yaklaşık **%2 değer** kazanmıştır.

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

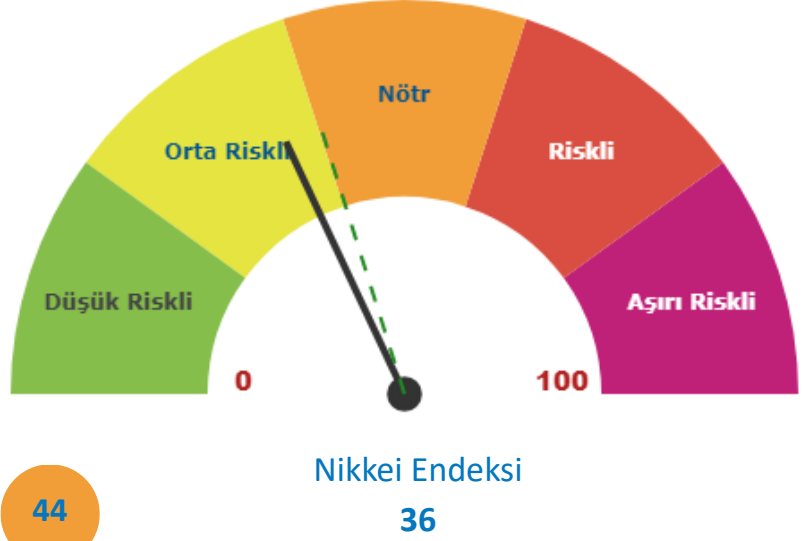


## NIKKEI

Geçen hafta nötr bölgeden **orta riskli** bölgeye geçiş yapan Japonya Hisse Senedi modeli düşük riskli yönde ilerlemeye devam ediyor.

Modelin 1 haftalık hareketi ile Nikkei Endeksinde **%3.5 getiri** gözlenmiştir.

Bu hafta **36** Bir hafta önce **40** Bir ay önce **44**

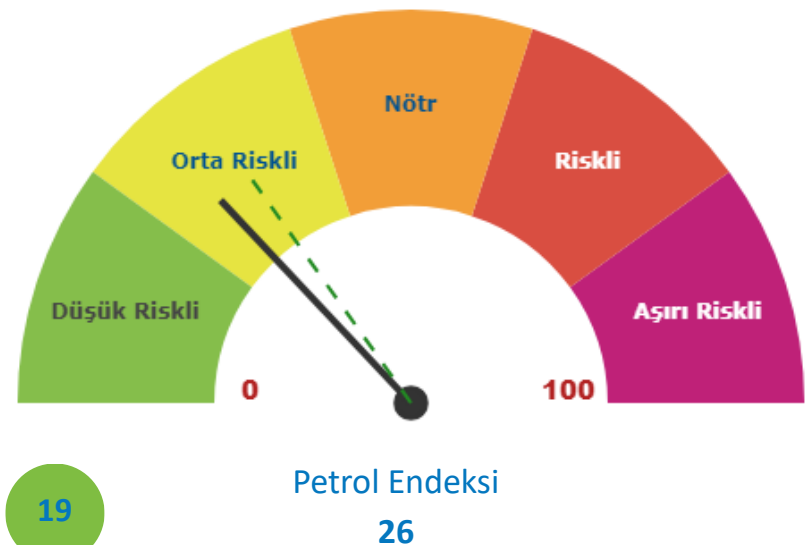


## PETROL

Petrol modeli 1 haftada **orta riskli** bölge içinde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Aynı dönemde petrol fiyatları **%3.5 değer** kazanmıştır.

Bu hafta **26** Bir hafta önce **30** Bir ay önce **19**



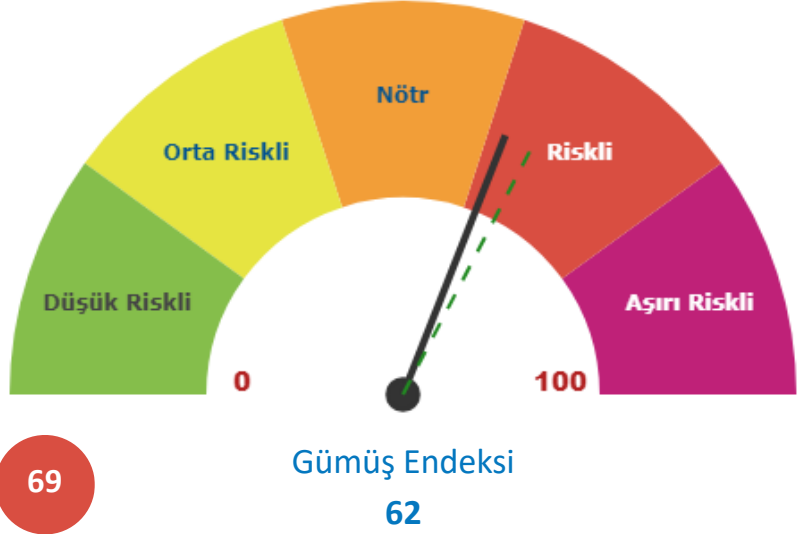
# RİSKOMETRE

## GÜMÜŞ

4 - 10 Eylül 2023

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

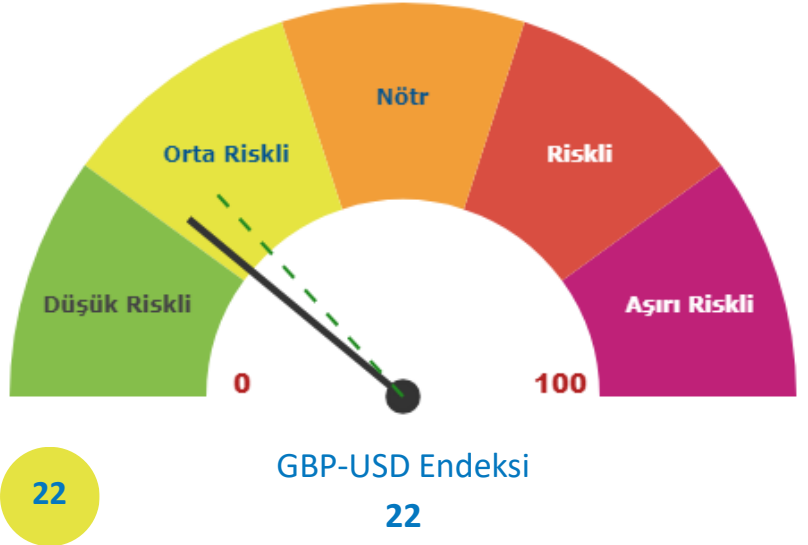
Modelin 1 haftalık hareketi sırasında gümüş fiyatları **%1.5** , 1 ayda ise **%2.5 değer** kazanmıştır.



## GBPUSD

GBPUSD modeli 1 haftalık ve 1 aylık dönemde **orta riskli** bölge içinde yer alırken, 1 haftada düşük riskli yöne ilerlemiştir.

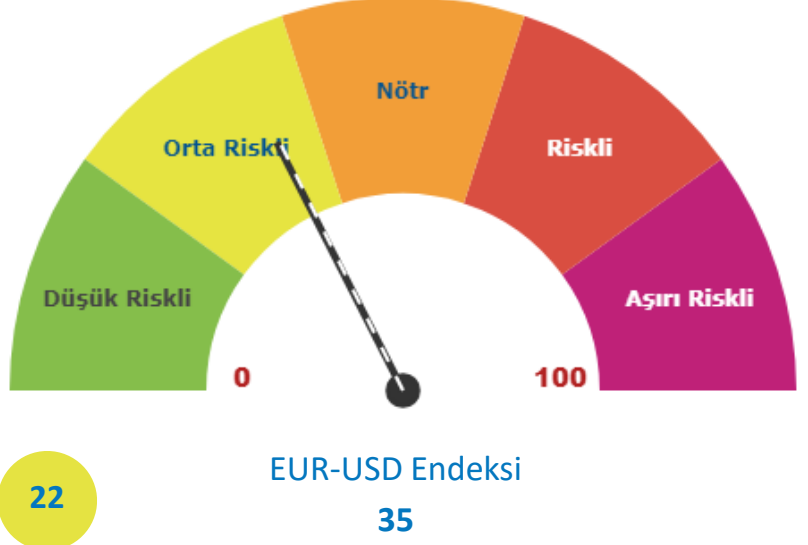
Modelin bu hareketi ile GBPUSD paritesi **%1 getiri** yapmıştır.



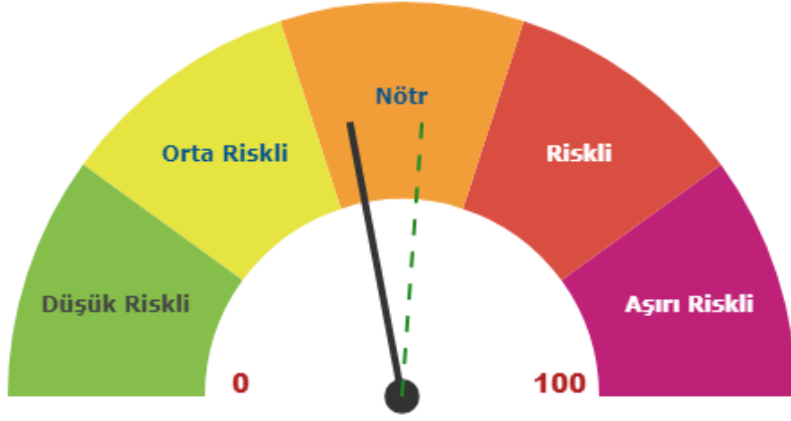
## EURUSD

EURUSD modeli 1 haftalık dönemde **orta riskli** bölge içinde stabil konumunu koruyor.

Modelin 1 ayda düşük riskli yöne ilerlemesi ile EURUSD paritesi yaklaşık **%1.5 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](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."