

# RİSKOMETRE

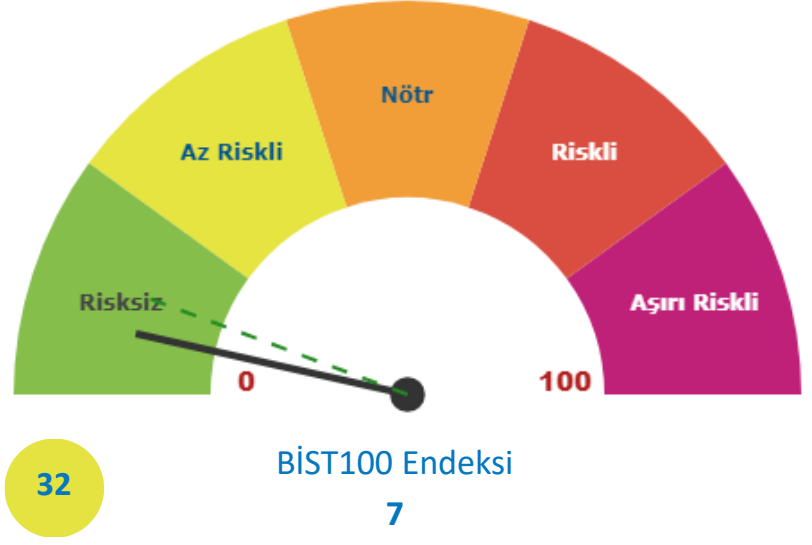
## BİST100

31 Temmuz - 5 Ağustos 2023

BİST100 modeli 1 haftalık ve 1 aylık dönemde **risksiz** yöne ilerlemiştir.

Modelin 1 haftalık hareketi ile BİST100 endeksi **%3.5 getiri** sağlamış, son 1 ayda ise model az riskli bölgeden risksiz bölgeye geçerken endeks yaklaşık **%18 getiri** yapmıştır.

Bu hafta **7** Bir hafta önce **11** Bir ay önce **32**

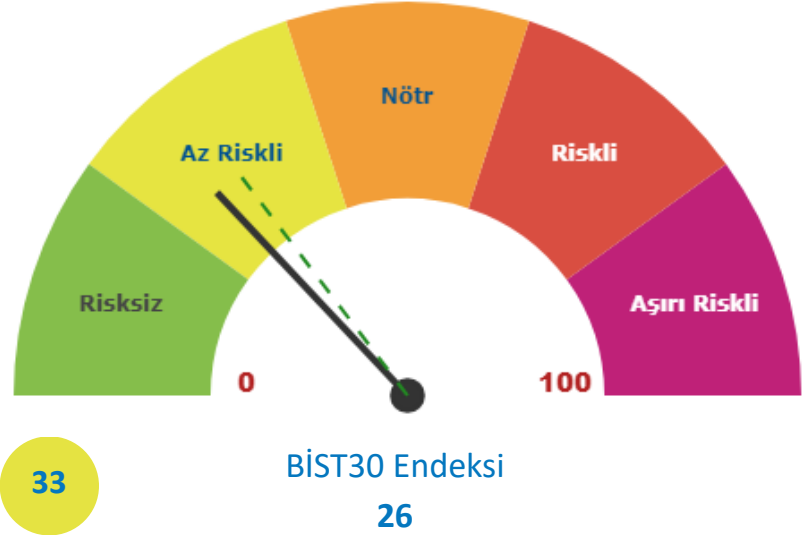


## BİST30

BİST30 modeli son 1 haftalık dönemde **az riskli** bölge içinde risksiz yöne ilerlemiştir.

Modelin 1 haftada risksiz yöndeki hareketi BİST30 Endeksi **%4 değer** kazanırken, 1 aylık dönemde ise **%16 değer** kazanmıştır.

Bu hafta **26** Bir hafta önce **29** Bir ay önce **33**

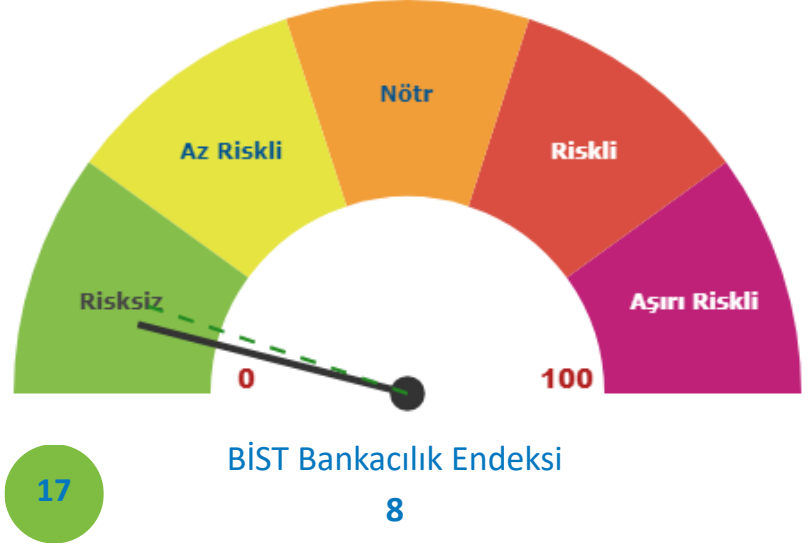


## BİST BANKACILIK

BİST Bankacılık modeli 1 haftalık ve 1 aylık dönemde **risksiz** yöne ilerlemiştir.

Son 1 haftada modelin risksiz yöndeki hareketi ile BİST Bankacılık endeksi **%8.5**, 1 aylık dönemde ise **%18 getiri** sağlamıştır.

Bu hafta **8** Bir hafta önce **10** Bir ay önce **17**

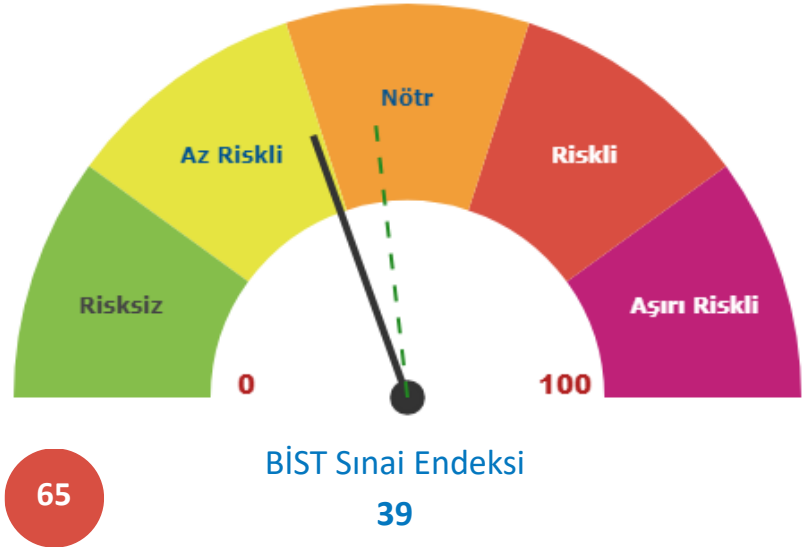


## BİST SINAI

BİST Sınai modeli son 1 haftalık ve 1 aylık dönemde **risksiz** yönde hareketini sürdürüyor.

Modelin 1 haftalık dönemde **az riskli** bölgeye geçişi ile BİST Sınai Endeksi **%4.5**, 1 ayda riskli bölgeden az riskli bölgeye geçişi ile yaklaşık **%19 değer** kazanmıştır.

Bu hafta **39** Bir hafta önce **46** Bir ay önce **65**

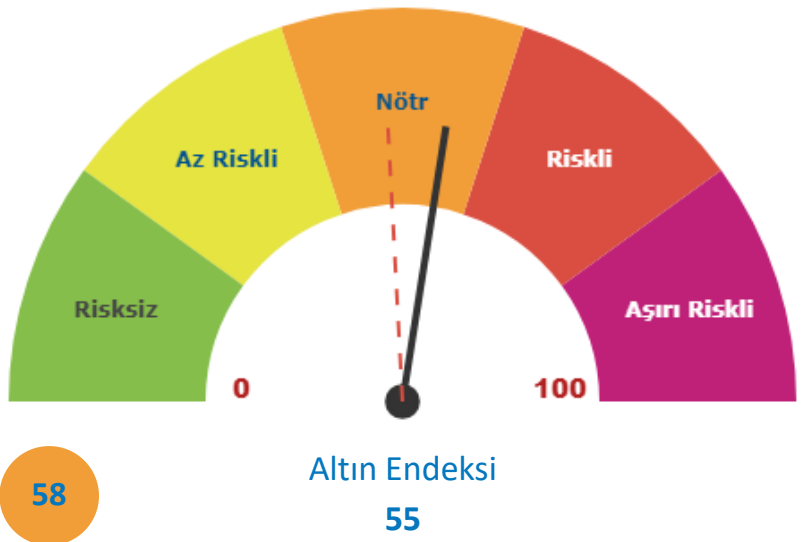


## ALTIN

Altın modeli son 1 haftalık dönemde **nötr** bölge içinde riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin riskli yöndeki bu hareketi ile altın fiyatları yaklaşık **%1 değer** kaybederken, 1 ayda yaklaşık **2% değer** kazanmıştır.

Bu hafta **55** Bir hafta önce **48** Bir ay önce **58**



# RİSKOMETRE

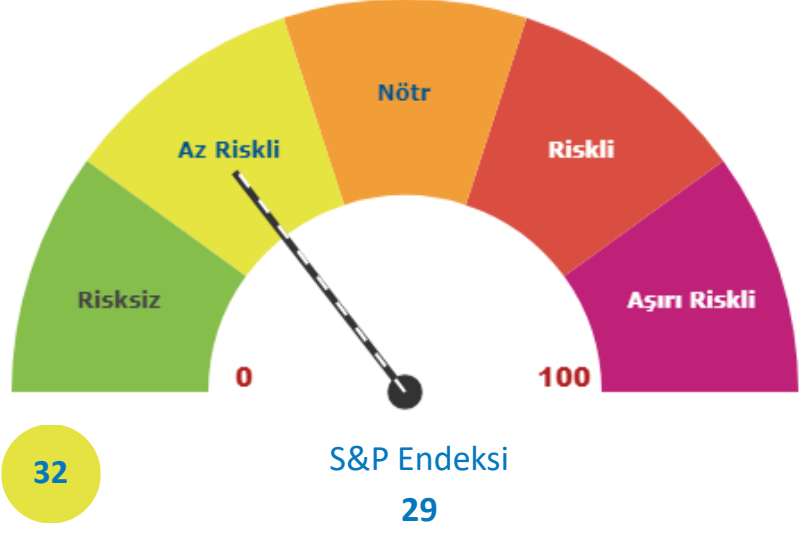
S&P

31 Temmuz - 5 Ağustos 2023

ABD Hisse Senedi modeli, son 1 haftada **az riskli** bölge içinde sabit görünümünü sürdürüyor.

Model 1 ayda risksiz yönde hareket ederken S&P endeksi bu dönemde **%5.5** getiri sağlamıştır.

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

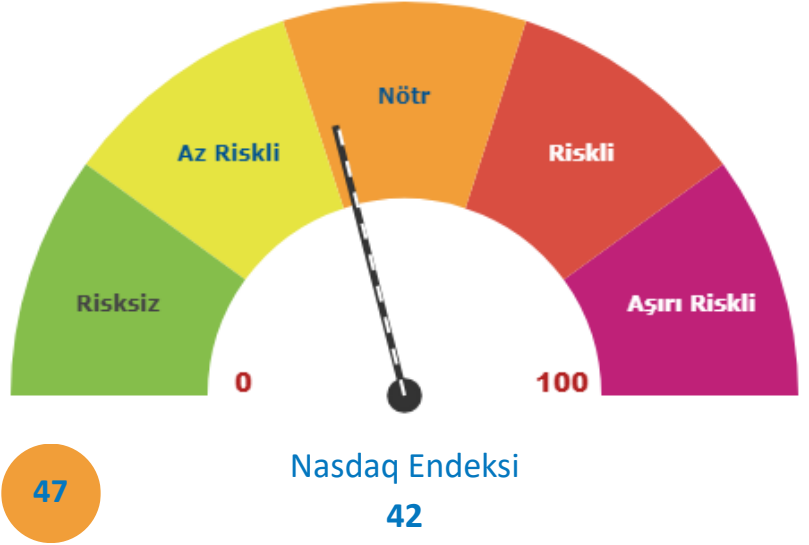


## NASDAQ

NASDAQ modeli son 1 haftalık dönemde **nötr** bölge içinde konumunu koruyor.

Son 1 aylık dönemde model az riskli sınırına yaklaşırken NASDAQ endeksi yaklaşık **%6 değer** kazanmıştır.

Bu hafta **42** Bir hafta önce **42** Bir ay önce **47**

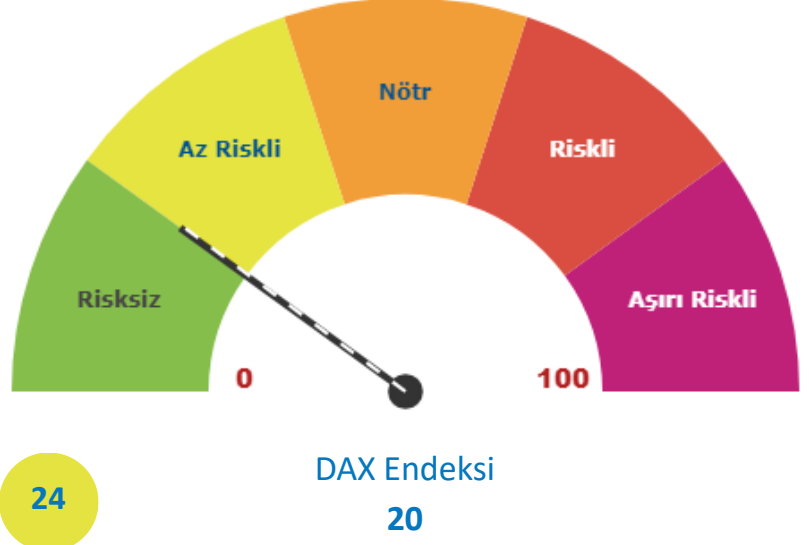


## DAX

Kısa ve orta vadede Alman Hisse Senedi modeli **risksiz** bölgede güvenli liman olmaya devam ediyor.

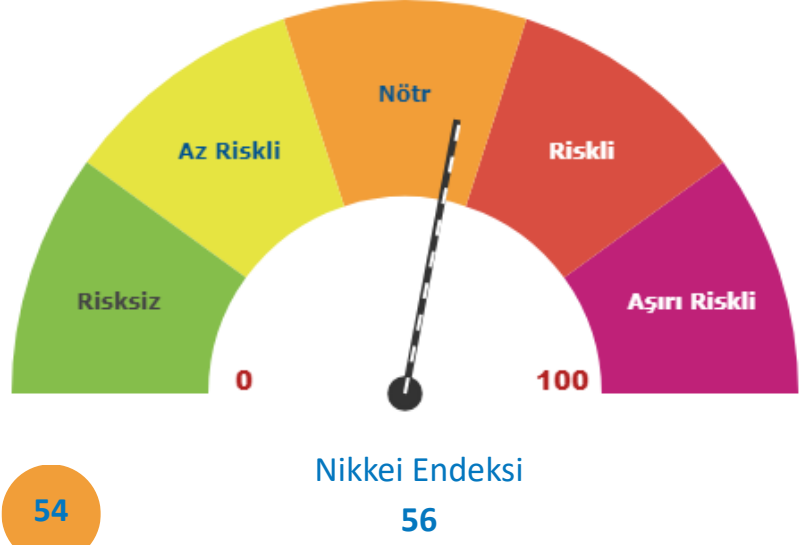
Modelin 1 aylık dönemde risksiz yöne ilerlerken DAX endeksi **%3.3 getiri** sağlamıştır.

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



## NIKKEI

Japonya Hisse Senedi modeli son 1 haftalık ve 1 aylık dönemde **nötr** görünümünü sürdürüyor.



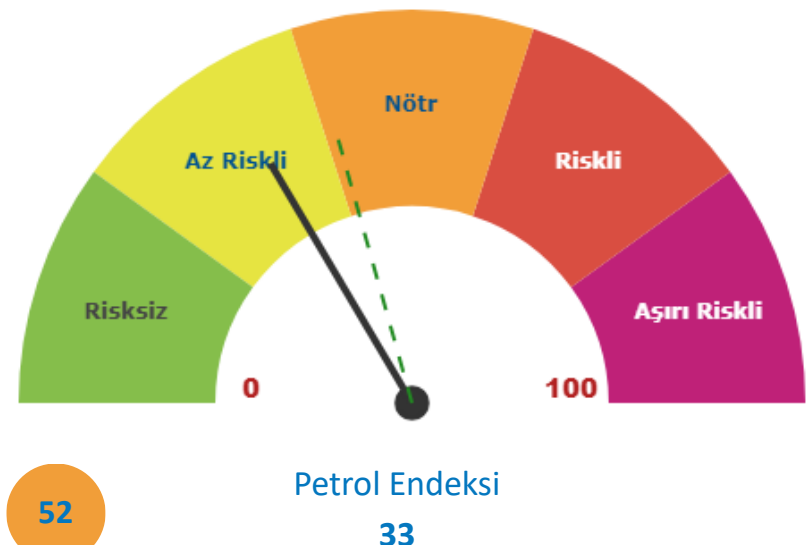
Bu hafta **56** Bir hafta önce **56** Bir ay önce **54**

## PETROL

Petrol modeli son 1 haftalık dönemde nötr bölgeden **az riskli** bölgeye geçiş yapmıştır.

Modelin 1 haftalık risksiz yöndeki hareketi petrol fiyatları **%5 değer** kazanırken, son 1 aylık hareketi ile **%15 getiri** sağlamıştır.

Bu hafta **33** Bir hafta önce **41** Bir ay önce **52**



# RİSKOMETRE

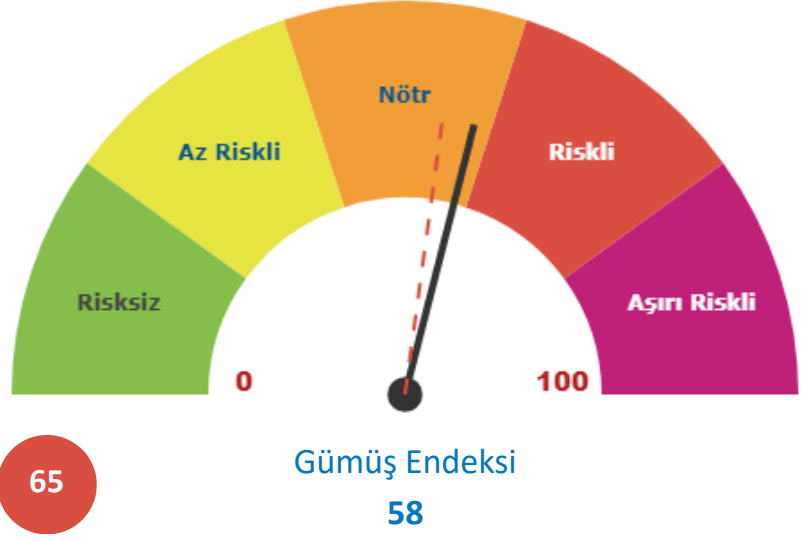
## GÜMÜŞ

31 Temmuz - 5 Ağustos 2023

Gümüş modeli 1 haftalık dönemde **nötr** bölge içinde riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin bu hareketi ile gümüş fiyatları **%2 değer** kaybederken, son 1 aylık dönemde riskli bölgeden nötr bölgeye geçişte yaklaşık **%6.5 değer** kazanmıştır.

Bu hafta **58** Bir hafta önce **54** Bir ay önce **65**

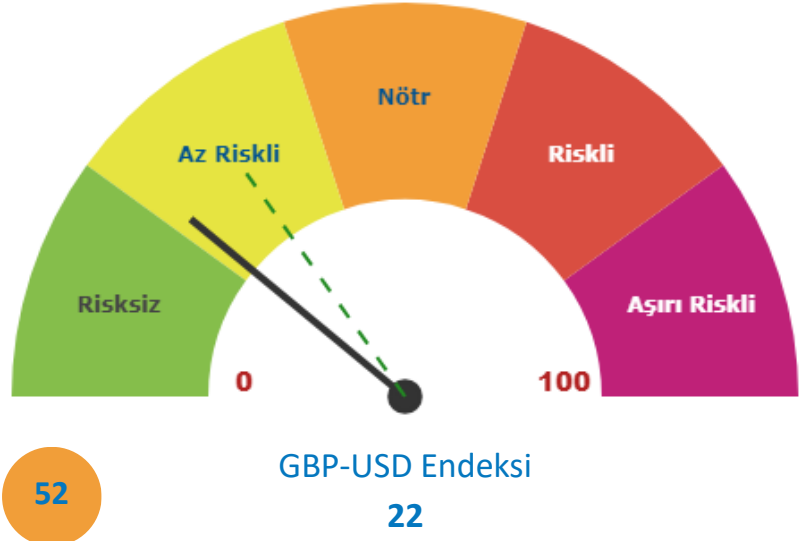


## GBP-USD

GBP-USD modeli **az riskli** bölge içinde risksiz bölge sınırına ilerlemiştir.

GBP-USD paritesi son 1 ayda nötr bölgeden az riskli bölgeye geçişte **%1.5 getiri** yapmıştır.

Bu hafta **22** Bir hafta önce **32** Bir ay önce **52**

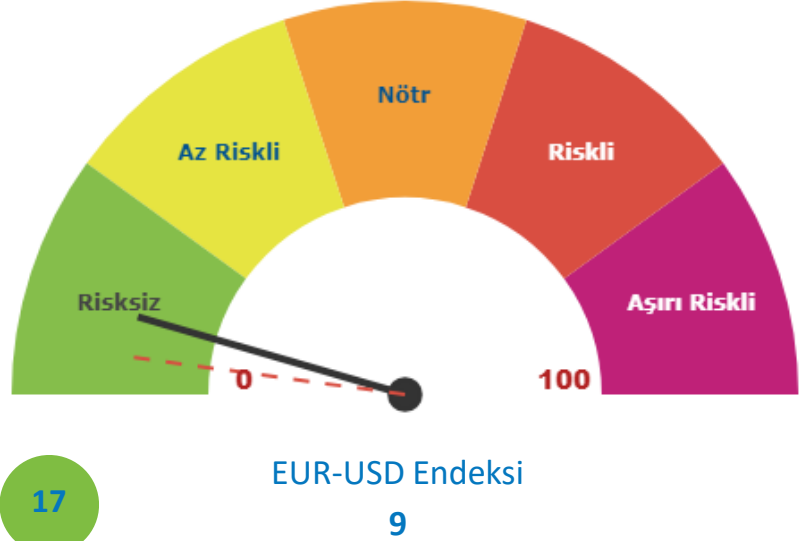


## EUR-USD

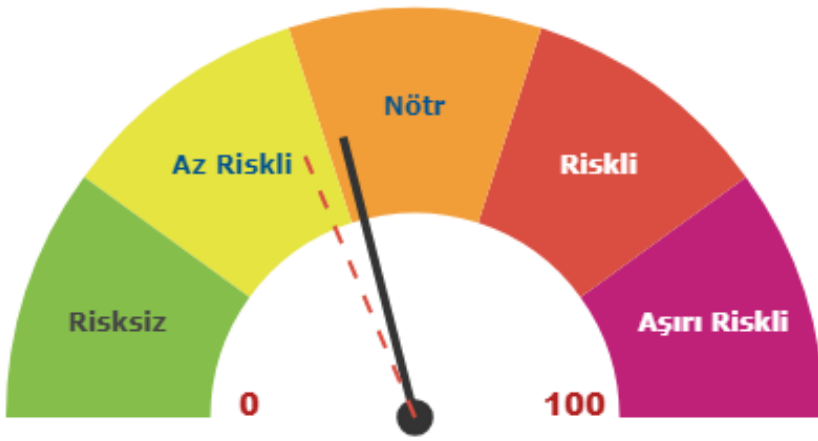
EURUSD modeli son bir haftalık dönemde **risksiz** bölge içinde riskli yöne ilerlemiştir.

Son 1 haftalık dönemde model riskli yöne ilerlerken, EUR-USD paritesi yaklaşık **%1.5 değer** kaybetmiş, 1 ayda risksiz yönde ilerlerken **%1 değer** kazanmıştır.

Bu hafta **9** Bir hafta önce **4** Bir ay önce **17**



## 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, değerler 0'a (Risksiz) yaklaştığında piyasa daha cesaretli ve risk almayı benimseyen bir yaklaşım sergiler.

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."