

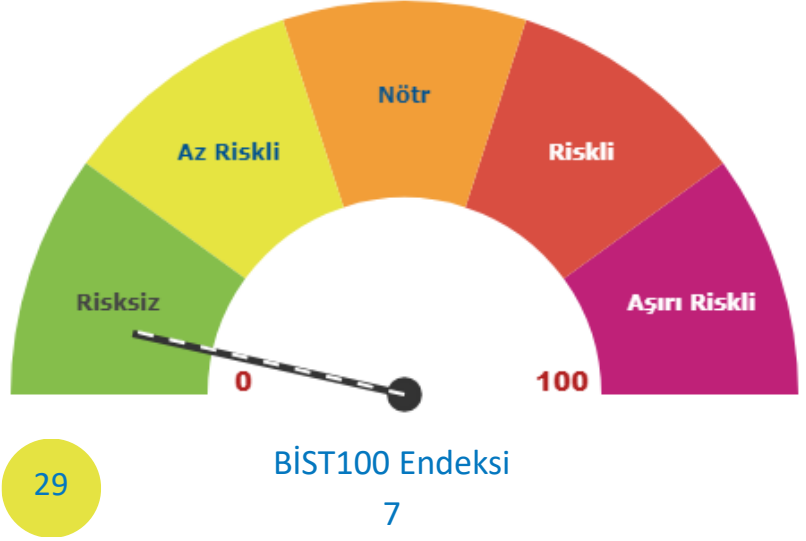
# RİSKOMETRE

## BİST100

7 Ağustos - 13 Ağustos 2023

BİST100 modeli 1 haftada **risksiz** bölgede stabil konumunu koruyor.

Modelin 1 ayda az riskli bölgeden risksiz bölgeye geçerken BİST100 endeksi **%17 getiri** yapmıştır.

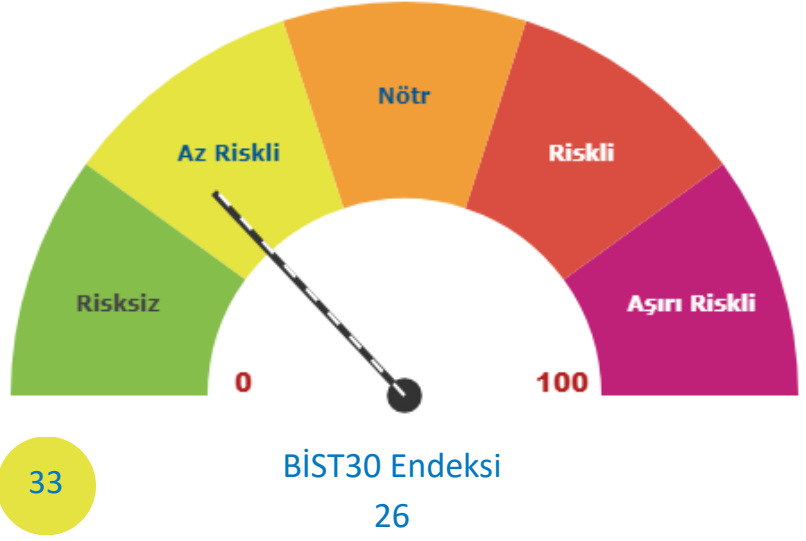


Bu hafta **7** Bir hafta önce **7** Bir ay önce **29**

## BİST30

BİST30 modeli son 1 haftalık dönemde az riskli bölge içinde kalmaya devam ediyor.

Son 1 aylık dönemde de **az riskli** bölgede bulunan modelin risksiz yöndeki hareketi ile BİST30 Endeksi **%14 değer** kazanmıştır.

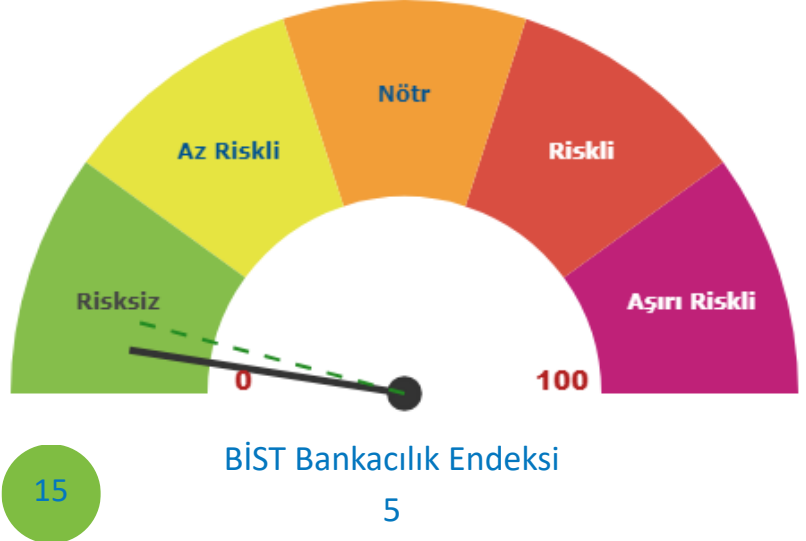


Bu hafta **26** Bir hafta önce **26** Bir ay önce **33**

## BİST BANKACILIK

1 Haftalık dönemde **risksiz** bölgede konumunu koruyan BİST Bankacılık modeli son 1 ayda risksiz yöne ilerlemiştir.

Modelin risksiz yönlü hareketi ile BİST Bankacılık endeksi 1 aylık dönemde **%20 getiri** sağlamıştır.

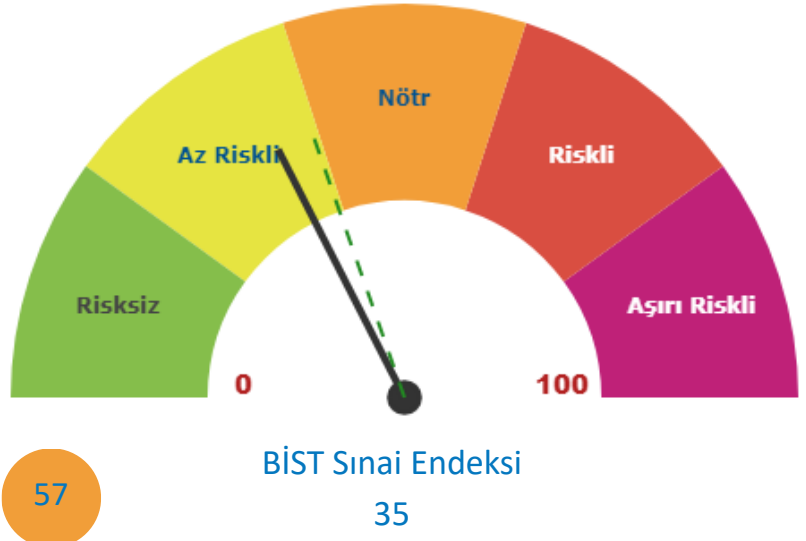


Bu hafta **5** Bir hafta önce **8** Bir ay önce **15**

## BİST SINAI

BİST Sınai modeli 1 ay içinde nötr bölgeden **az riskli** bölgeye geçiş yaparken 1 haftada az riskli bölge içinde pozitif yönde ilerlemiştir.

Model ile eş zamanlı olarak BİST Sınai Endeksi 1 haftada **%6**, 1 ayda **%16 getiri** sağlamıştır.

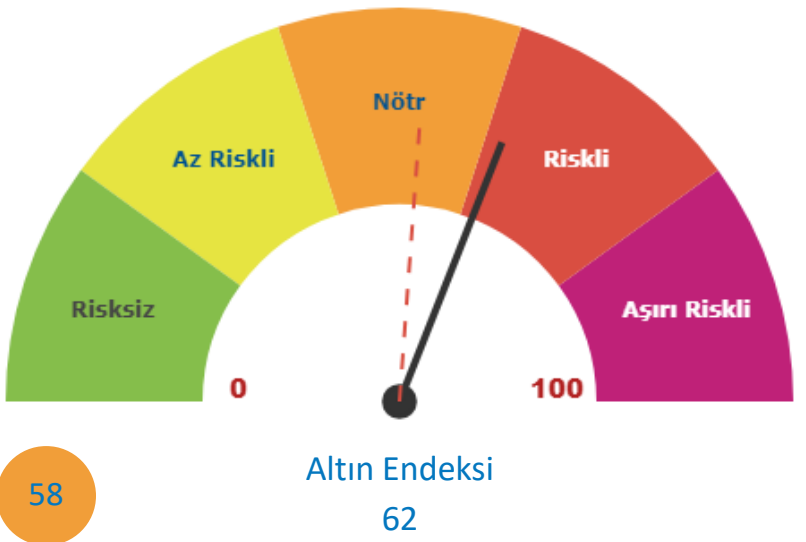


Bu hafta **35** Bir hafta önce **39** Bir ay önce **57**

## ALTIN

Uzun vadede nötr bölge içinde bulunun altın modeli son 1 haftalık dönemde **riskli** bölgeye geçiş yapmıştır.

Modelin bölge geçişi ile altın fiyatlarında yaklaşık **%2 değer kaybı** yaşanmıştır.



Bu hafta **62** Bir hafta önce **55** Bir ay önce **58**

# RİSKOMETRE

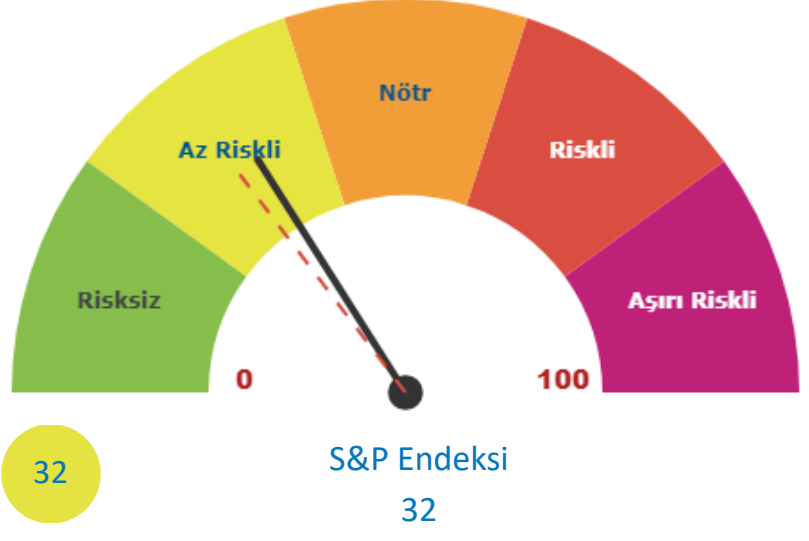
S&P

31 Temmuz - 5 Ağustos 2023

ABD Hisse Senedi modeli, son 1 hafta ve 1 ay içinde **az riskli** bölge içinde durağan konumunu koruyor.

Model riskli yöne ilerlerken S&P endeksinde yaklaşık **%2 değer** kaybı yaşanmıştır.

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

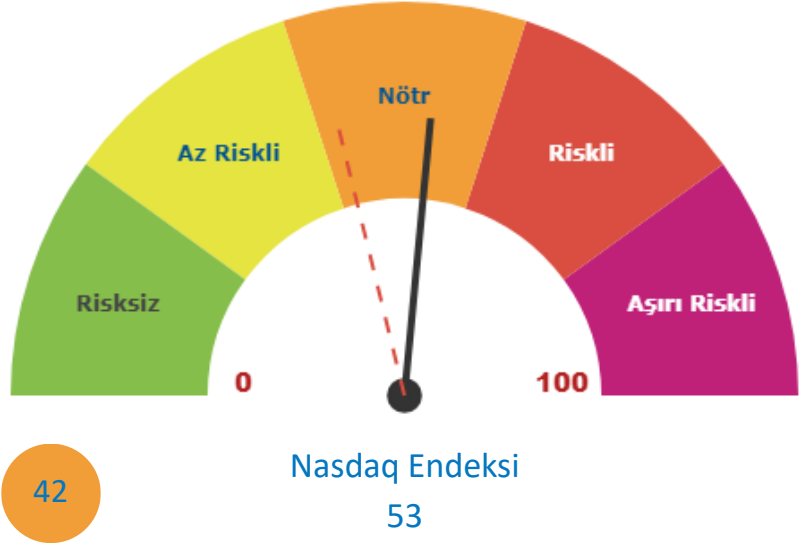


## NASDAQ

NASDAQ modeli son 1 haftalık dönemde **nötr** bölge içinde riskli yönde ilerlemiştir.

Modelin bu hareketi ile Nasdaq Endeksi yaklaşık **%2 değer kaybı** yaşamıştır.

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

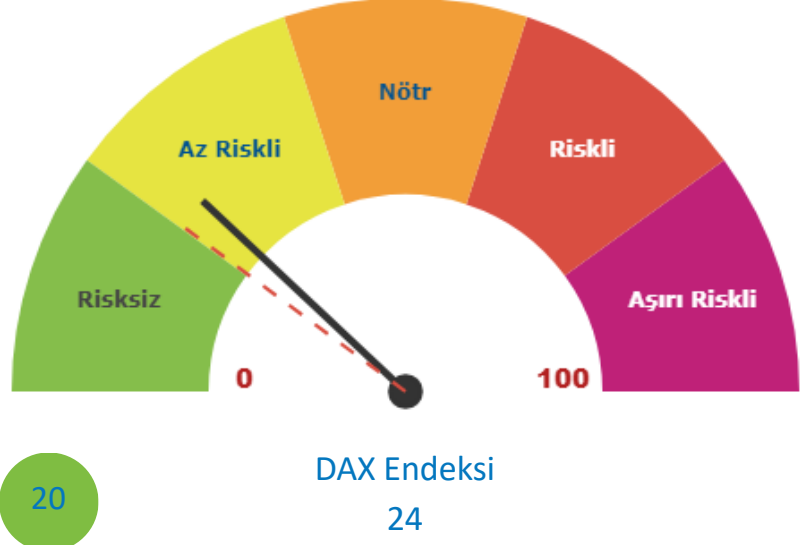


## DAX

Bir süredir risksiz bölgede stabil seyreden DAX modeli riskli yöne hareket etmiş ve risksiz bölgeyi terketmiş **az riskli** bölgeye gelmiştir.

Modelin 1 haftalık hareketi ile eşzamanlı olarak DAX endeksi **%3.5 değer kaybı** yaşamıştır.

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

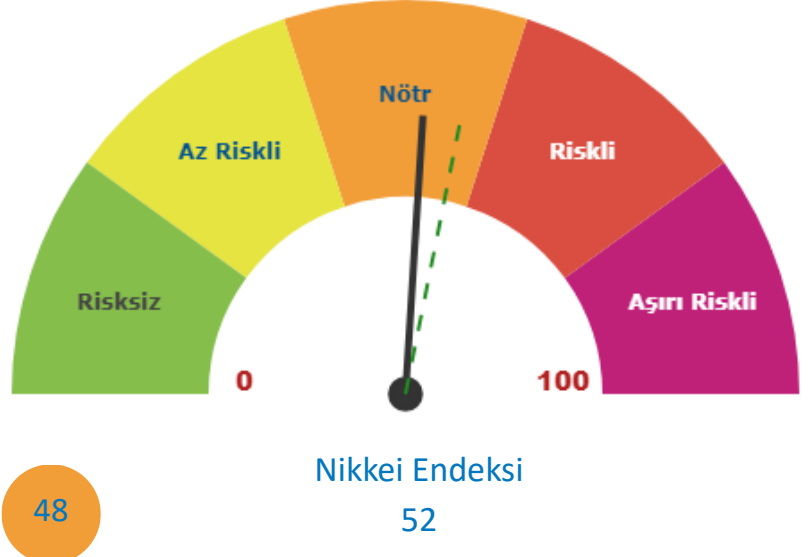


## NIKKEI

Japonya Hisse Senedi modeli son 1 haftalık dönemde **nötr** bölge içinde risksiz yönde ilerliyor.

1 aylık dönemde modelin riskli yönde hareketi ile Nikkei Endeksi yaklaşık **%5 değer** kaybetmiştir.

Bu hafta **52** Bir hafta önce **56** Bir ay önce **48**

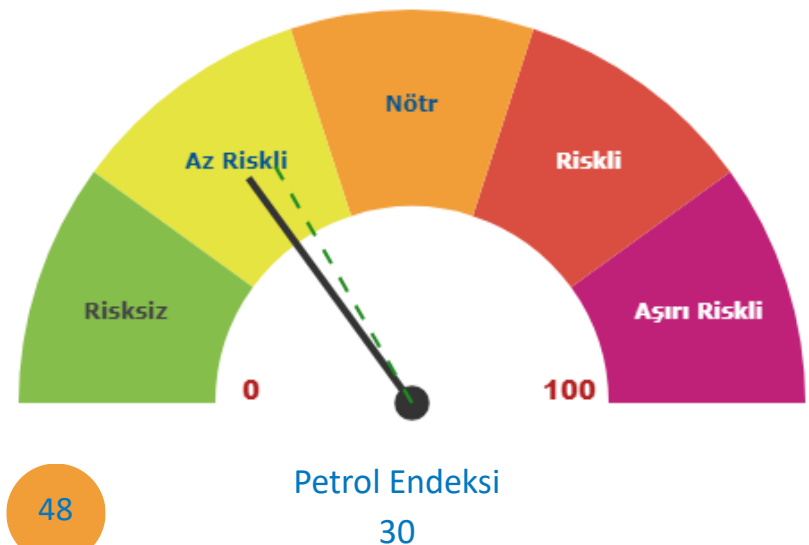


## PETROL

Petrol modeli 1 haftalık ve 1 aylık periyotlarda az **riskli** bölgede risksiz yönde ilerlemeye devam ediyor.

Son 1 ayda petrol yaklaşık **%12 değer kazanırken** bunun **%1,5** kısmını son 1 haftada yapmıştır.

Bu hafta **30** Bir hafta önce **33** Bir ay önce **48**



# RİSKOMETRE

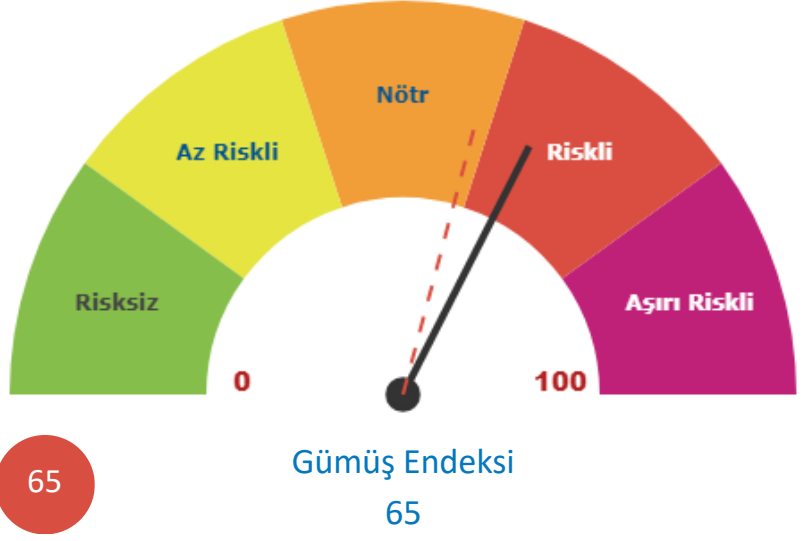
## GÜMÜŞ

31 Temmuz - 5 Ağustos 2023

Gümüş modeli 1 haftalık dönemde nötr bölge sınırından **riskli** bölgeye geçiş yapmıştır.

Modelin bu hareketi ile paralel olarak gümüş fiyatları 1 haftada **%2.5 değer** kaybetmiştir.

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

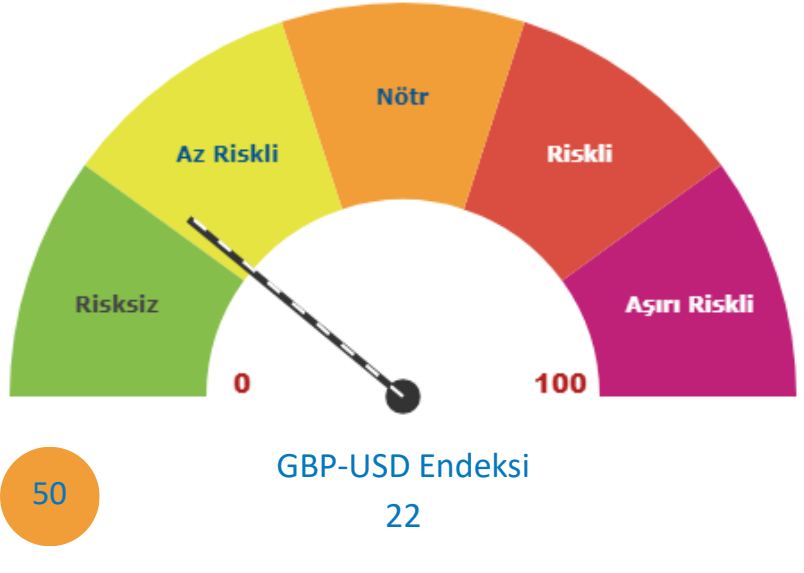


## GBP-USD

GBP-USD modeli az riskli bölge içinde konumunu koruyor.

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

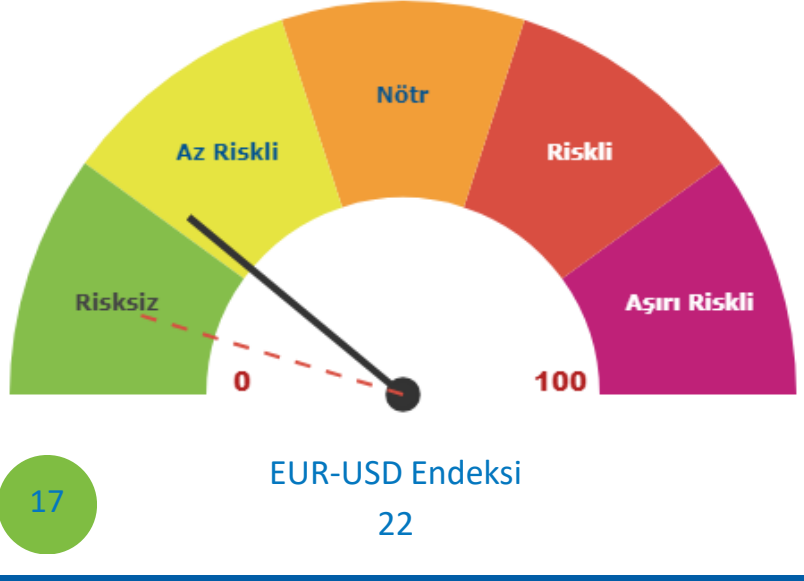
Bu hafta **22** Bir hafta önce **22** Bir ay önce **50**



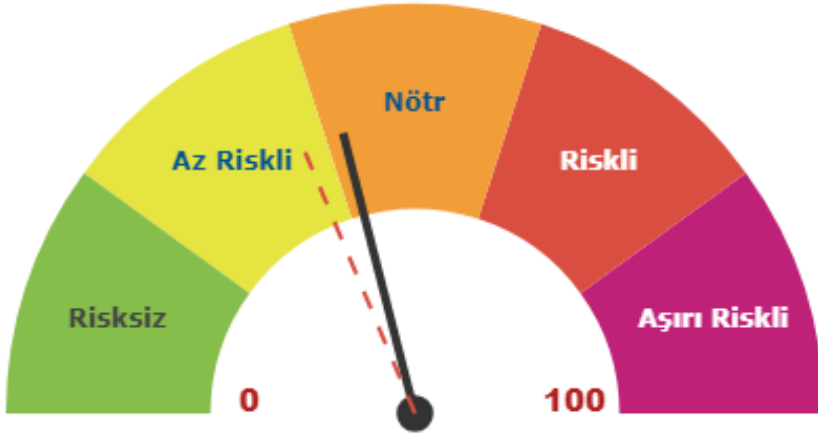
## EUR-USD

EURUSD modeli son bir haftalık dönemde risksiz bölgeden **az riskli** bölgeye geçiş yapmıştır. Bu süreçte model riskli yönde ilerlerken EUR-USD paritesinde yaklaşık **%1 değer kaybı** gözlenmiştir.

Bu hafta **22** Bir hafta önce **9** 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 dayanılarak yapılacak ileriye dönük yatırımlar ve ticari işlemlerin sonuçlarından ya da ortaya çıkabilecek zararlardan Fibabanka A.Ş. sorumlu tutulamaz."