

RİSKOMETRE

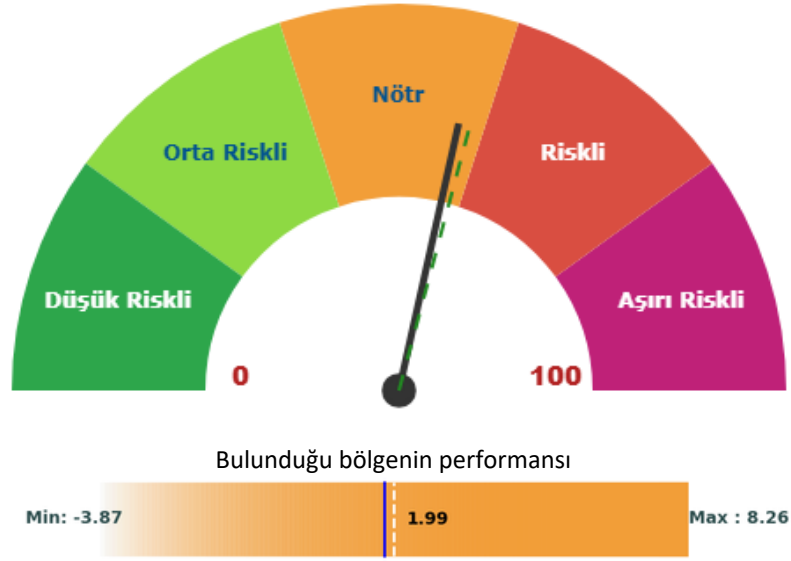
BIST100

9 - 15 Aralık 2024

BIST100 Modeli bu hafta, geçen hafta geçiş yaptığı **nötr bölge** içinde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

BIST100 Endeksi, modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda **yaklaşık %10 değer kazanmıştır**. Model bu bölgeye girdiğinden beri BIST100 Endeksi performansı, bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının hafif altında bulunmaktadır**.

Bu hafta **57** Bir hafta önce **58** Bir ay önce **84**

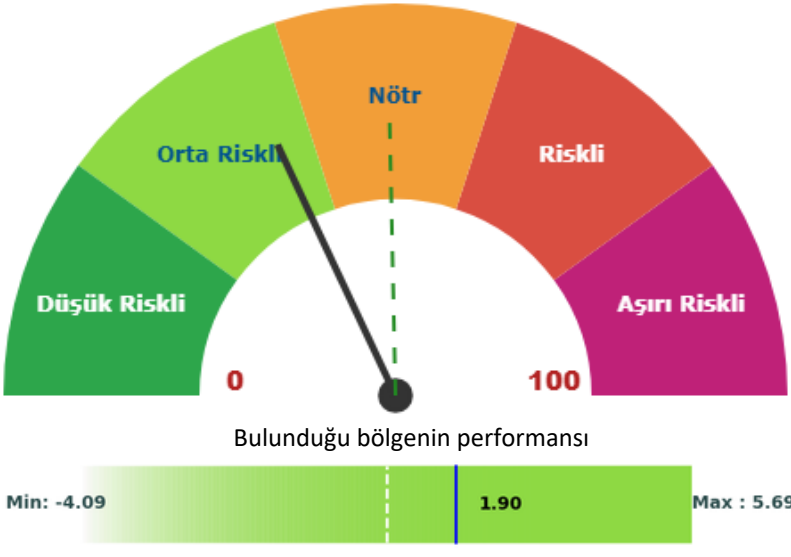


BIST TEKNOLOJİ

BIST Teknoloji Modeli bu hafta düşük riskli yöne ilerleyerek nötr bölgeden **orta riskli bölgeye** geçiş yapmıştır.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda BIST Teknoloji Endeksi yaklaşık **%9 değer kazanmıştır**. BIST Teknoloji Endeksi performansı orta riskli bölgeye girdiğinden beri **bu bölgedeki tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır**.

Bu hafta **36** Bir hafta önce **49** Bir ay önce **57**

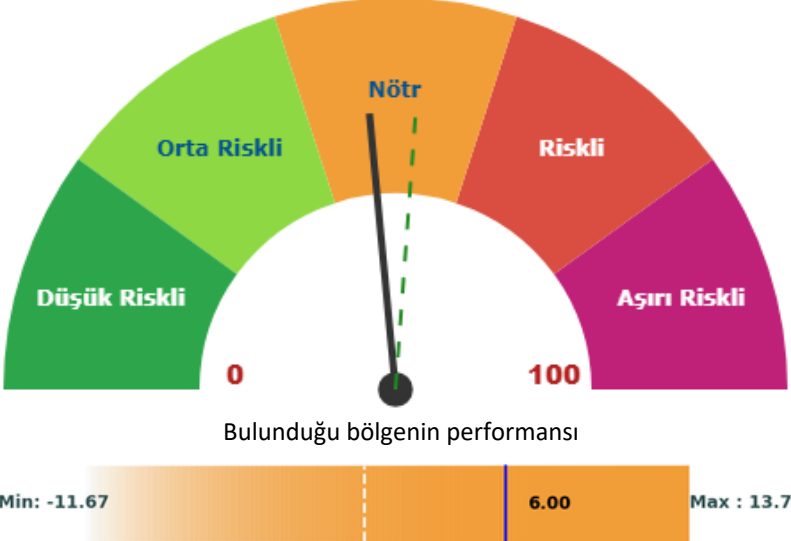


BIST BANKACILIK

1 aylık dönemde riskli bölgeden **nötr bölgeye** geçiş yapan BIST Bankacılık modeli bu hafta da düşük riskli yöne ilerleyişini sürdürmüştür.

BIST Bankacılık Endeksi, modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda **yaklaşık %26.5 değer kazanmıştır**. Model nötr bölgeye girdiğinden beri BIST Bankacılık Endeksi performansı bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır**.

Bu hafta **47** Bir hafta önce **52** Bir ay önce **78**

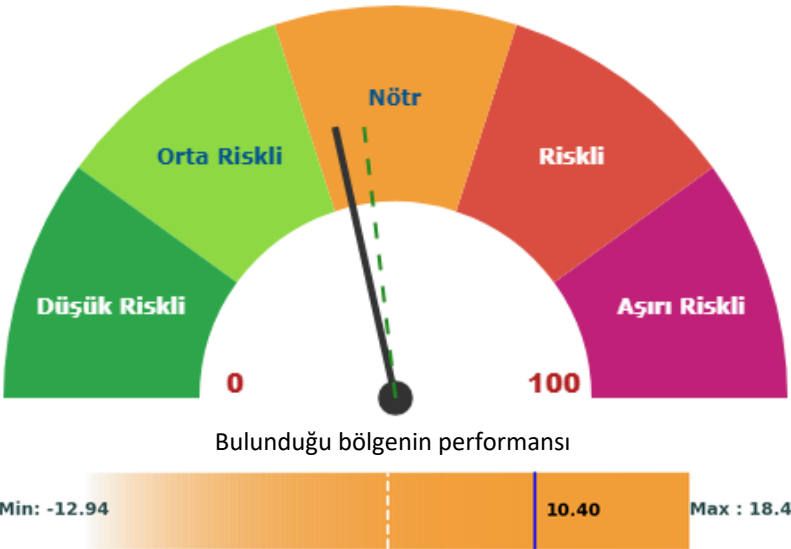


BIST SINAI

1 aylık dönemde nötr sinyali veren BIST Sınai modeli bu hafta **nötr bölge** içinde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Model düşük riskli yöne ilerlerken BIST Sınai Endeksi **1 ayda yaklaşık %7 değer kazanmıştır**. Model nötr bölgeye girdiğinden beri BIST Sınai Endeksi performansı bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde seyretmektedir**.

Bu hafta **43** Bir hafta önce **46** Bir ay önce **51**

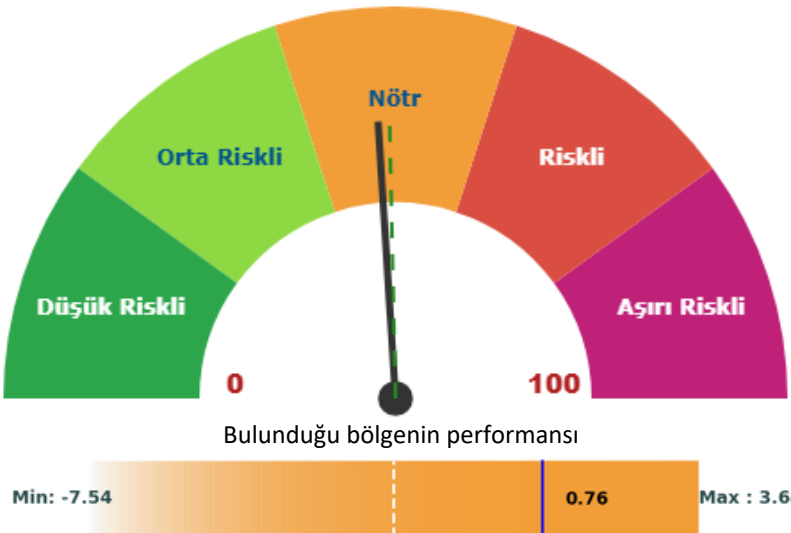


ALTIN

Altın Modeli 1 aylık dönemde **nötr bölge** içinde yer alırken riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 ayda Altın fiyatları **yaklaşık %2 değer kaybı yaşamıştır**. Model nötr bölgeye girdiğinden beri Altının getirisi bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde yer almaktadır**.

Bu hafta **48** Bir hafta önce **44** Bir ay önce **42**



RİSKOMETRE

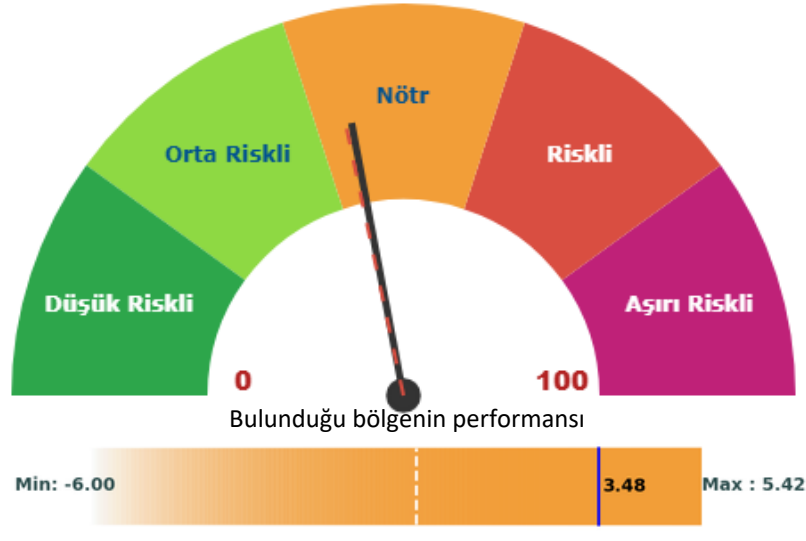
S&P

9 - 15 Aralık 2024

ABD Hisse Senedi modeli 1 ayda **nötr bölge** içinde yer alırken düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda S&P Endeksi yaklaşık **%2 değer kazanmıştır**. Model nötr bölgeye girdiğinden beri S&P Endeksinin performansı, bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde yer almaktadır**.

Bu hafta **43** Bir hafta önce **44** Bir ay önce **45**

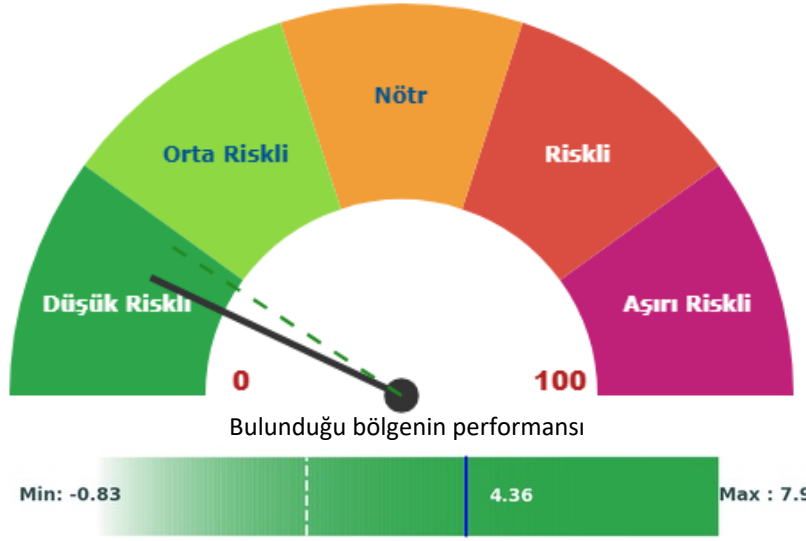


NASDAQ

NASDAQ modeli 1 aydır **düşük riskli bölgede** yer alırken bu hafta düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada endeks yaklaşık **%3.5 değer kazanmıştır**. Model düşük riskli bölgeye girdiğinden beri endeksin getirisi bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde yer almaktadır**.

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

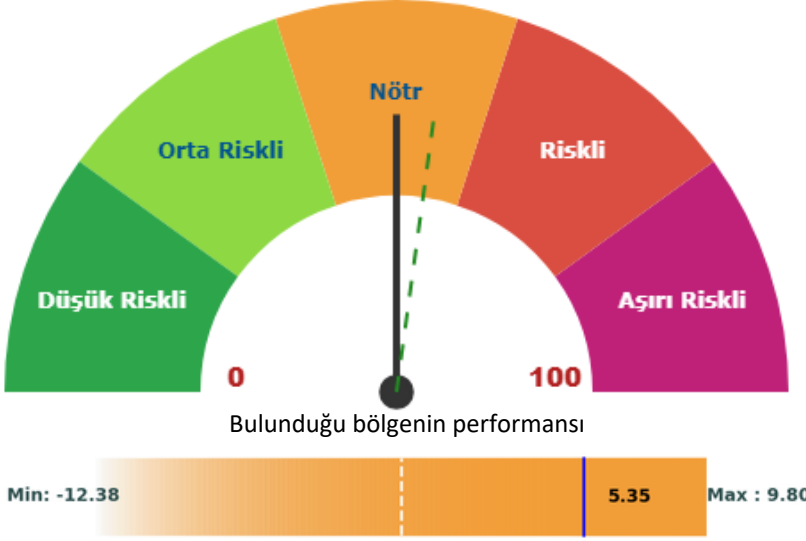


DAX

Almanya Hisse Senedi modeli 1 aylık dönemde **nötr bölge** içinde yer alırken bu hafta düşük riskli yöne ilerlemiştir.

DAX Endeksi modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda **yaklaşık %6 getiri sağlamıştır**. DAX Endeksi performansı nötr bölgeye girdiğinden beri bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır**.

Bu hafta **50** Bir hafta önce **54** Bir ay önce **52**

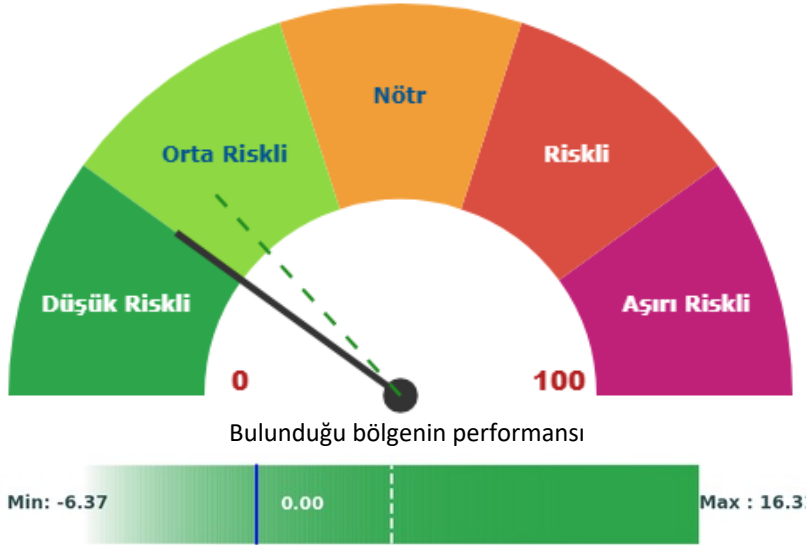


NIKKEI

Geçen hafta orta riskli bölgeyi test eden Japonya Hisse Senedi bu hafta **düşük riskli** bölgeye dönüş yapmıştır.

Nikkei Endeksi, modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada **yaklaşık %2.5 değer kazanmıştır**. Nikkei Endeksinin getirisi düşük riskli bölgeye girdiğinden beri bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında bulunmaktadır**.

Bu hafta **20** Bir hafta önce **26** Bir ay önce **17**

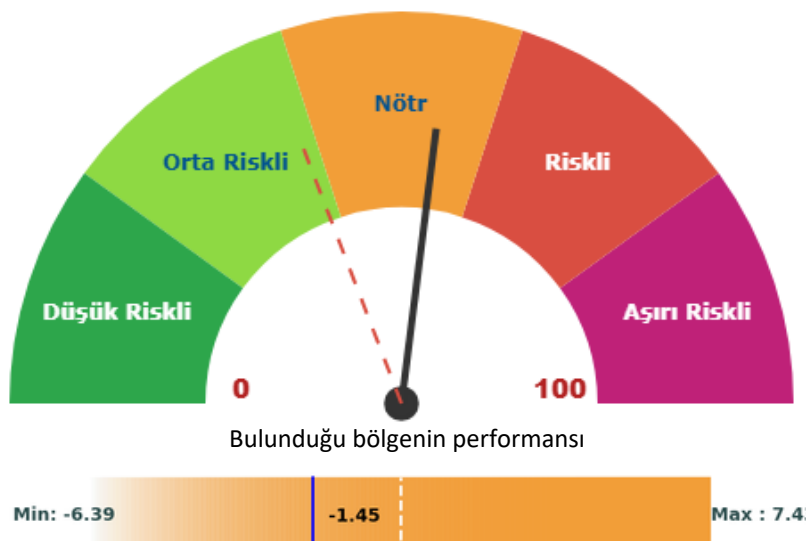


PETROL

1 aylık dönemde dalgalı seyreden Petrol modeli bu hafta **nötr bölgeye** dönüş yapmıştır.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 ayda petrol fiyatları **yaklaşık %4 değer kaybetmiştir**. Model nötr bölgeye girdiğinden beri petrolün getirisi bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında bulunmaktadır**.

Bu hafta **54** Bir hafta önce **38** Bir ay önce **50**



RİSKOMETRE

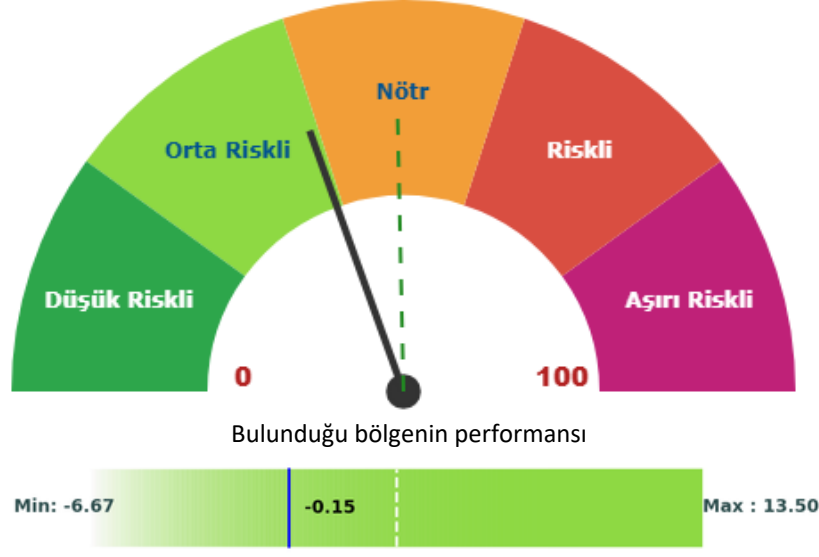
GÜMÜŞ

9 - 15 Aralık 2024

Geçen hafta nötr bölgeyi test eden Gümüş modeli bu hafta **orta riskli bölgeye** dönüş yapmıştır.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada Gümüş fiyatları **yaklaşık %2.2 değer kazanmıştır**. Gümüşün getiri performansı bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında** bulunmaktadır.

Bu hafta **39** Bir hafta önce **49** Bir ay önce **34**

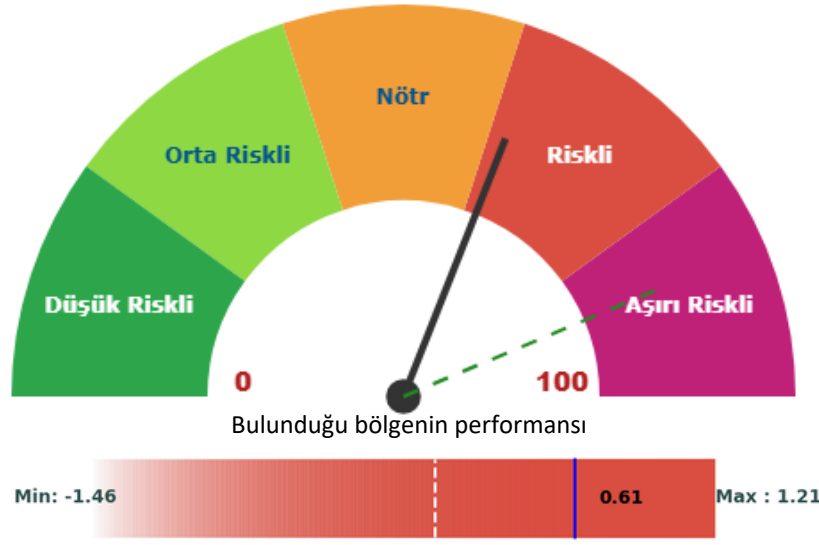


GBPUSD

GBPUSD modeli 1 aylık dönemde aşırı riskli bölgeden **riskli bölgeye** geçiş yapmıştır.

GBPUSD paritesi modelin riskli sinyali verdiği 1 ayda **yaklaşık %1 değer kaybetmiştir**. GBPUSD parite getirisi riskli bölgeye girdiğinden beri bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde** yer almaktadır.

Bu hafta **62** Bir hafta önce **87** Bir ay önce **82**

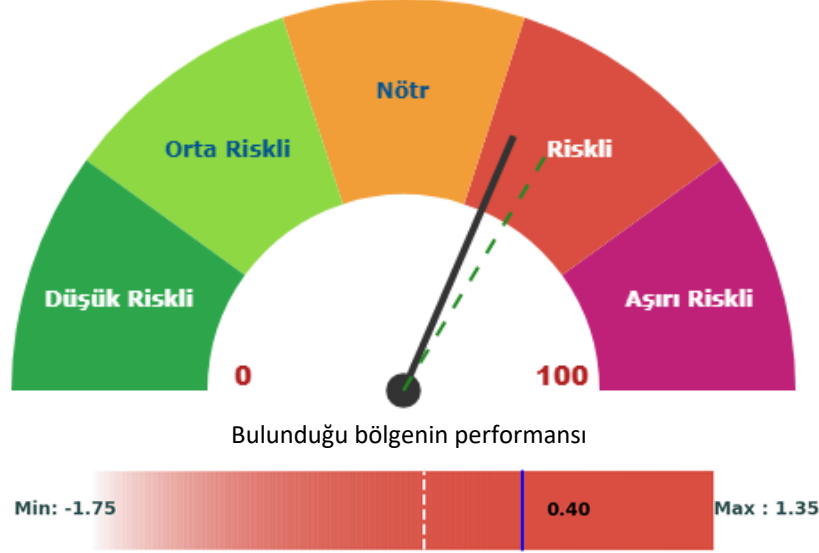


EURUSD

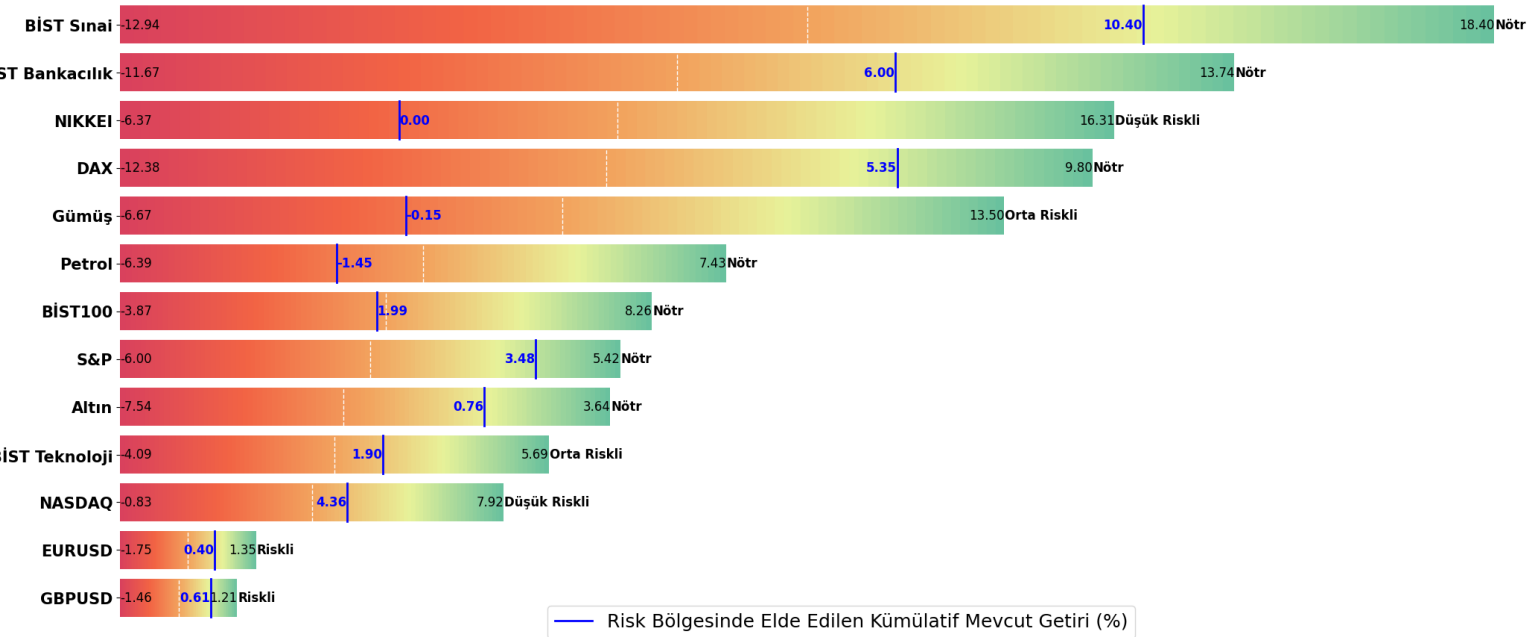
1 aylık dönemde riskli yöne ilerleyen EURUSD modeli bu hafta **riskli bölge** içinde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Model 1 ayda riskli yöne ilerlerken EURUSD paritesi yaklaşık **%1.5 değer kaybetmiştir**. EURUSD paritesi performansı riskli bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde** bulunmaktadır.

Bu hafta **63** Bir hafta önce **67** Bir ay önce **52**

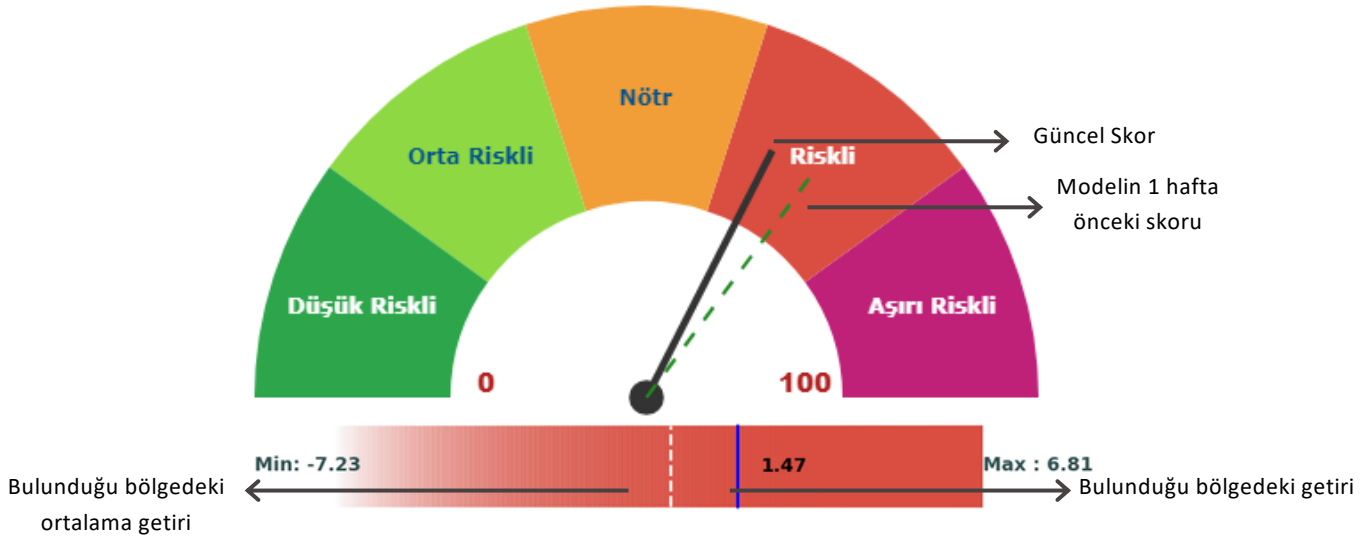


Bulunduğu Bölgeye Göre Getiri Bantları



*Grafikte sunulan veriler, ilgili varlık modelinin mevcut bulunduğu risk bölgesi içerisinde kaydedilen kümülatif minimum ve maksimum getiri oranlarını temsil etmektedir. Kesikli beyaz renkli çizgi ise risk bölgesinde elde ettiği ortalama getiriyi göstermektedir. Mavi renkte işaretlenen çizgi, varlık modelinin söz konusu **risk bölgesine giriş yaptığı andan itibaren** elde ettiği mevcut getiriyi göstermektedir.

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:

arfcap
www.arf.capital

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 dayanılarak 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."