

RİSKOMETRE

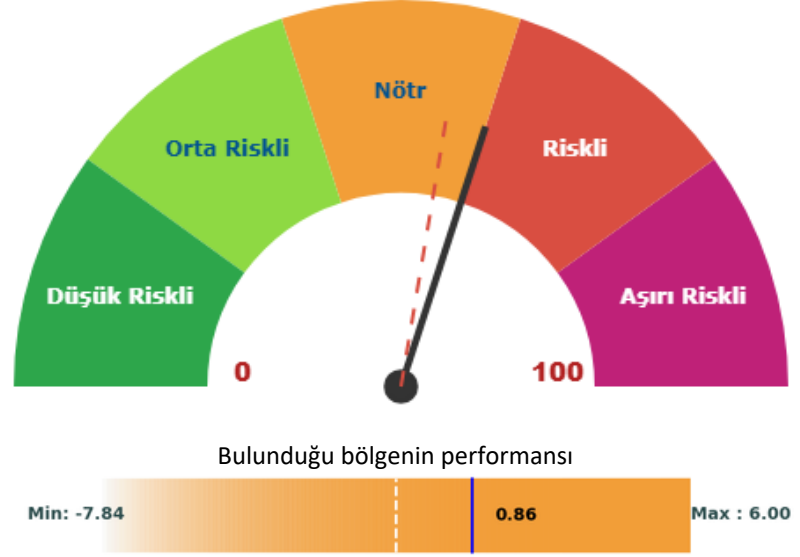
BİST100

10 - 16 Şubat 2025

BİST100 Modeli bu hafta **nötr bölge** içinde riskli yöne ilerleyerek 1 ay önceki konumuna dönüş yapmıştır.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftada BİST100 Endeksi **yaklaşık %1.5 değer kaybı yaşamıştır**. Model nötr bölgeye girdiğinden beri BİST100 Endeksi performansı, bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır**.

Bu hafta **60** Bir hafta önce **55** Bir ay önce **60**

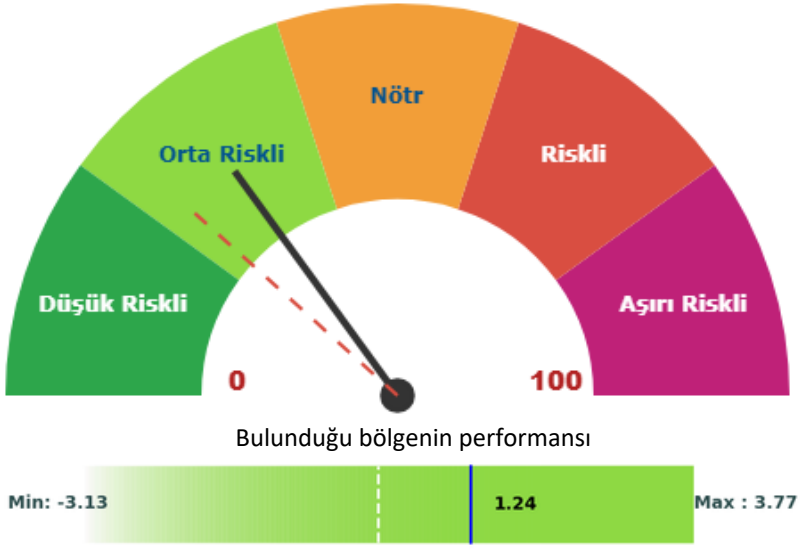


BİST TEKNOLOJİ

BİST Teknoloji modeli 1 aylık dönemde **orta riskli bölge** içinde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda BİST Teknoloji Endeksi **yaklaşık %2.5 değer kazanmıştır**. BİST Teknoloji Endeksi getiri performansı orta riskli bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde yer almaktadır**.

Bu hafta **30** Bir hafta önce **23** Bir ay önce **33**



BİST BANKACILIK

Geçtiğimiz hafta orta riskli bölgeyi test eden BİST Bankacılık modeli bu hafta **nötr bölgeye** dönüş yapmıştır.

BİST Bankacılık Endeksi, modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftada yaklaşık **%3.5 değer kaybetmiştir**. Model nötr bölgeye girdiğinden beri endeksin performansı bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altındadır**.

Bu hafta **43** Bir hafta önce **39** Bir ay önce **45**

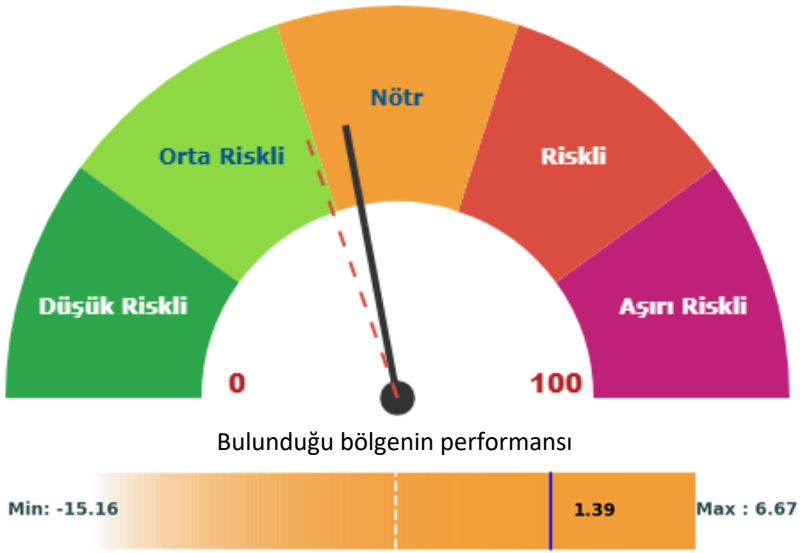


BİST SINAI

BİST Sınai Modeli bu hafta orta riskli bölgeden **nötr bölgeye** geçiş yapmıştır.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 ayda BİST Sınai Endeksi **yaklaşık %3.3 değer kaybı yaşamıştır**. Model bu bölgeye girdiğinden beri BİST Sınai Endeksi performansı nötr bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde yer almaktadır**.

Bu hafta **44** Bir hafta önce **39** Bir ay önce **33**

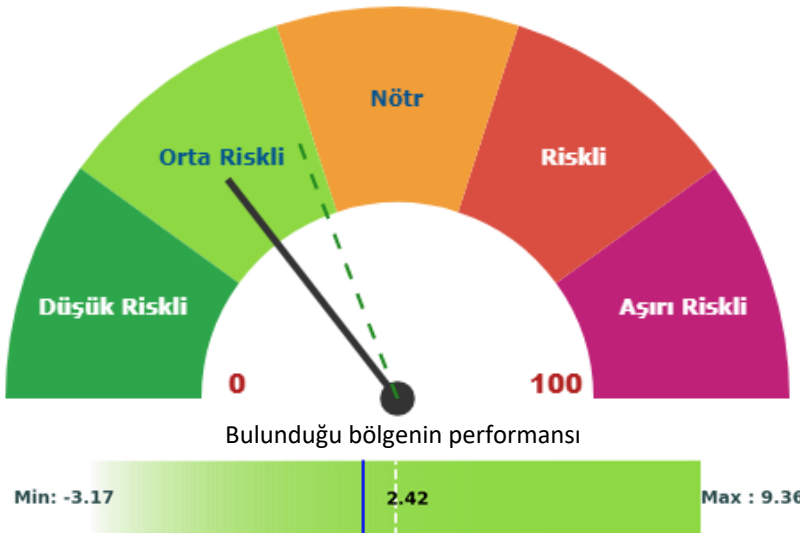


ALTIN

Altın modeli 1 aylık dönemde **düşük riskli** yöne ilerlemiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 aylık dönemde Altın fiyatları **yaklaşık %6.5 değer kazanmıştır**. Model orta riskli bölgeye girdiğinden beri Altının getirisi bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında yer almaktadır**.

Bu hafta **29** Bir hafta önce **38** Bir ay önce **58**



RİSKOMETRE

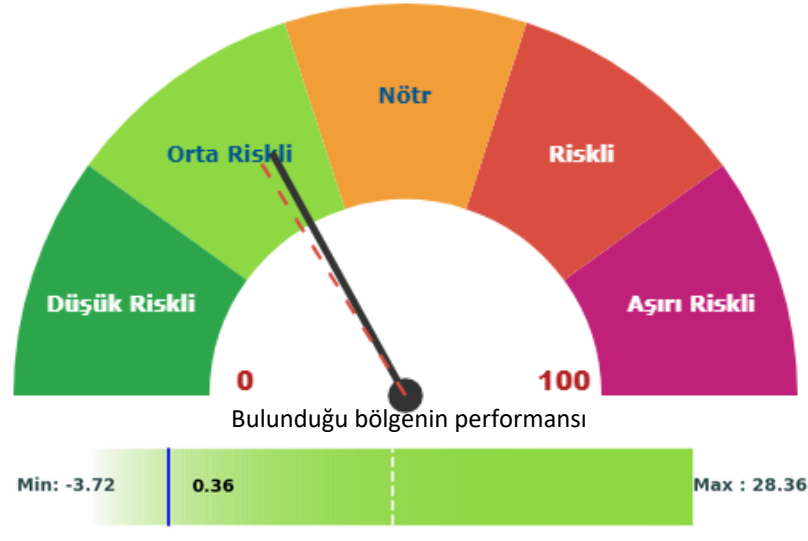
S&P

10 - 16 Şubat 2025

1 aylık dönemde düşük riskli yöne ilerleyen ABD Hisse Senedi modeli bu hafta **orta riskli bölge** içinde riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda S&P Endeksi yaklaşık **%4.4 değer kazanmıştır**. S&P Endeksi performansı orta riskli bölgeye girdiğinden beri **ortalamanın altında seyretmektedir**.

Bu hafta **34** Bir hafta önce **32** Bir ay önce **53**

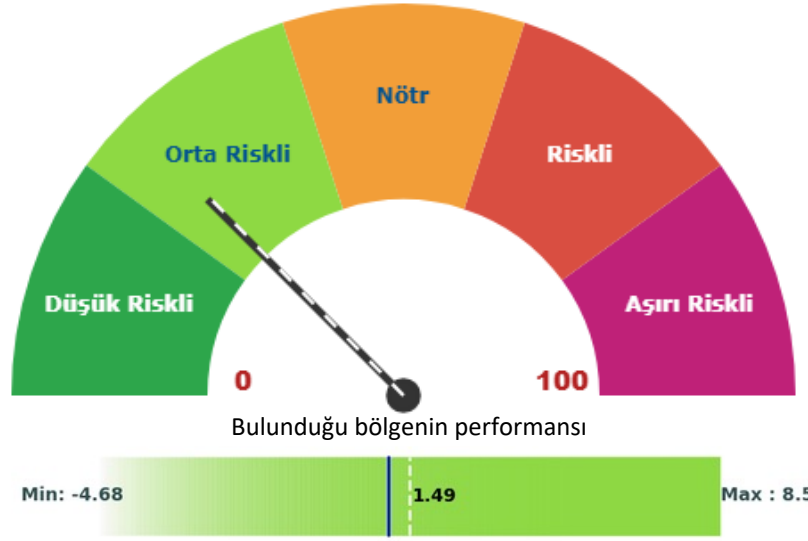


NASDAQ

Nasdaq Modeli 1 aylık dönemde **orta riskli bölge** içinde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda endeks yaklaşık **%2.8 getiri sağlamıştır**. Model orta riskli bölgeye girdiğinden beri endeksin getirisi bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında yer almaktadır**.

Bu hafta **25** Bir hafta önce **25** Bir ay önce **31**

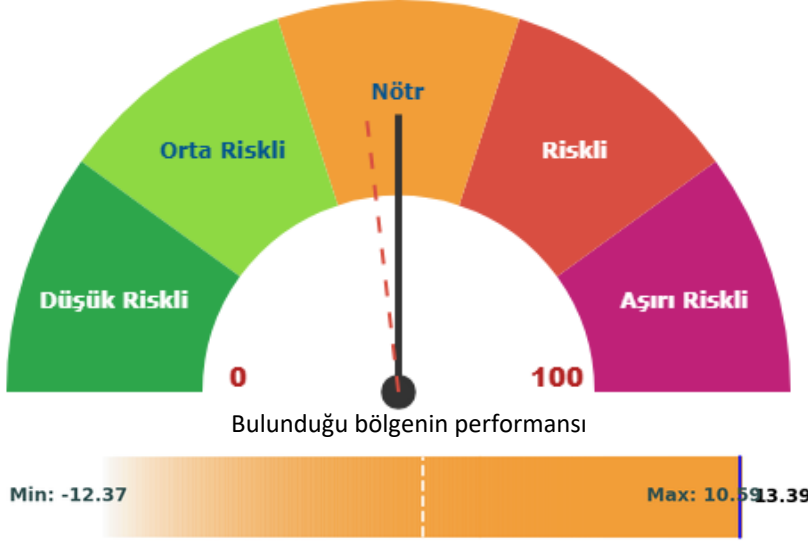


DAX

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

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda DAX Endeksi **%8.5 değer kazanmıştır**. Model nötr bölgeye girdiğinden beri DAX Endeksi getiri performansı bu bölgedeki **tarihsel maksimum değerinin yakınında bulunmaktadır**.

Bu hafta **50** Bir hafta önce **46** Bir ay önce **54**

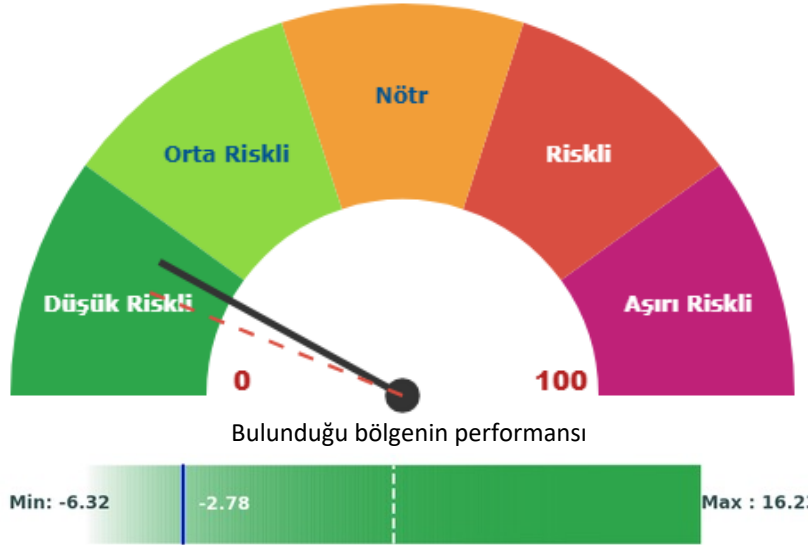


NIKKEI

1 aylık dönemde **düşük riskli bölgede** yer alan Japonya Hisse Senedi modeli bu hafta riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftada Nikkei Endeksi **yaklaşık %2 değer kaybetmiştir**. Nikkei Endeksinin getirisi düşük riskli bölgeye girdiğinden beri bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında bulunmaktadır**.

Bu hafta **16** Bir hafta önce **12** Bir ay önce **14**

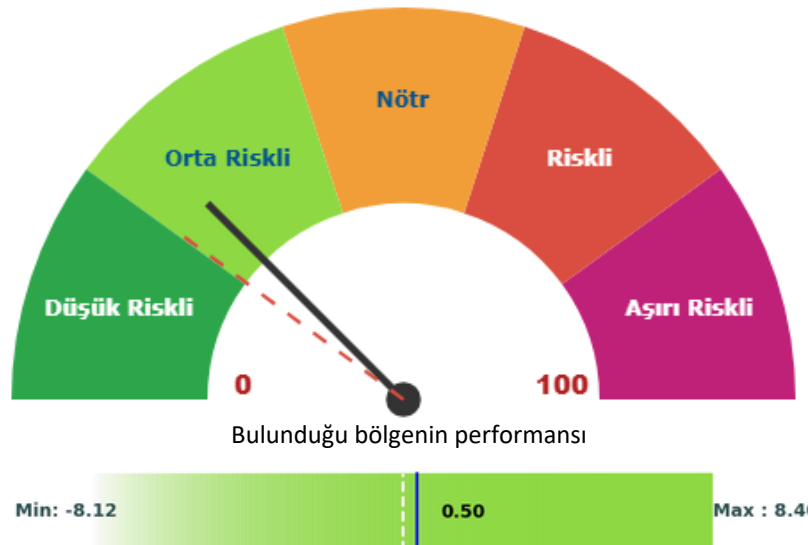


PETROL

Petrol modeli bu hafta düşük riskli bölgeden **orta riskli bölgeye** geçiş yapmıştır.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 ayda petrol fiyatları **yaklaşık %6 değer kaybı yaşamıştır**. Model orta riskli bölgeye girdiğinden beri petrolün getirisi bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde yer almaktadır**.

Bu hafta **25** Bir hafta önce **20** Bir ay önce **15**



RİSKOMETRE

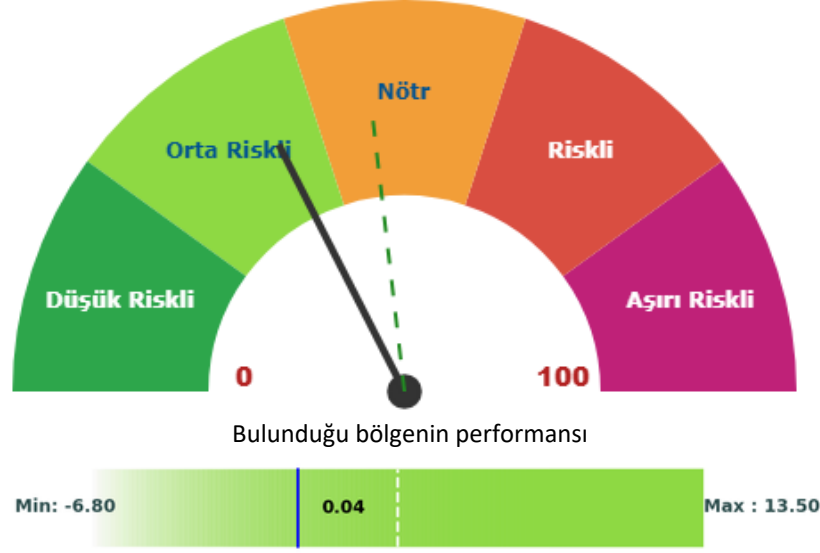
GÜMÜŞ

10 - 16 Şubat 2025

Gümüş modeli bu hafta nötr bölgeden **orta riskli bölgeye** geçiş yapmıştır.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda Gümüş fiyatları **%6.3 getiri sağlamıştır**. Gümüşün getiri performansı orta riskli bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında** bulunmaktadır.

Bu hafta **35** Bir hafta önce **46** Bir ay önce **53**

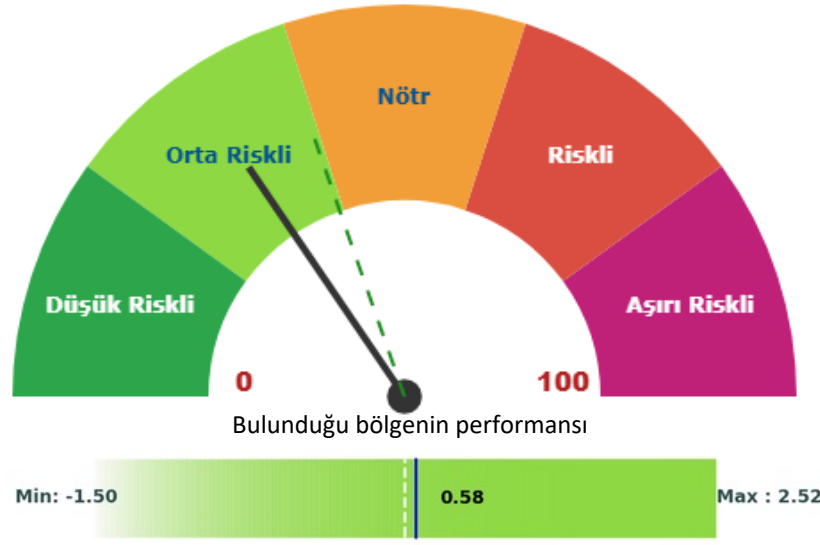


GBPUSD

Orta riskli bölgede bulunan GBPUSD modeli 1 aylık dönemde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda GBPUSD parite getirisi yaklaşık **%2.15** olmuştur. GBPUSD parite getirisi orta riskli bölgeye girdiğinden beri bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde** yer almaktadır.

Bu hafta **31** Bir hafta önce **39** Bir ay önce **92**

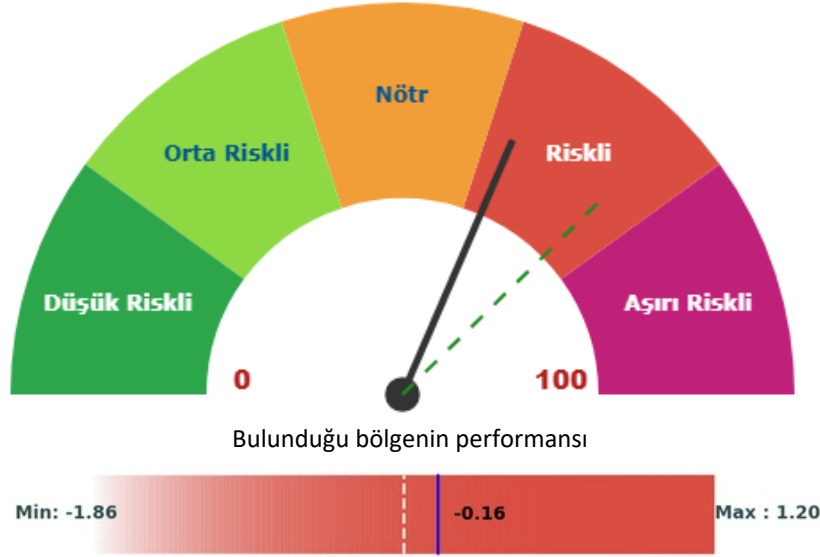


EURUSD

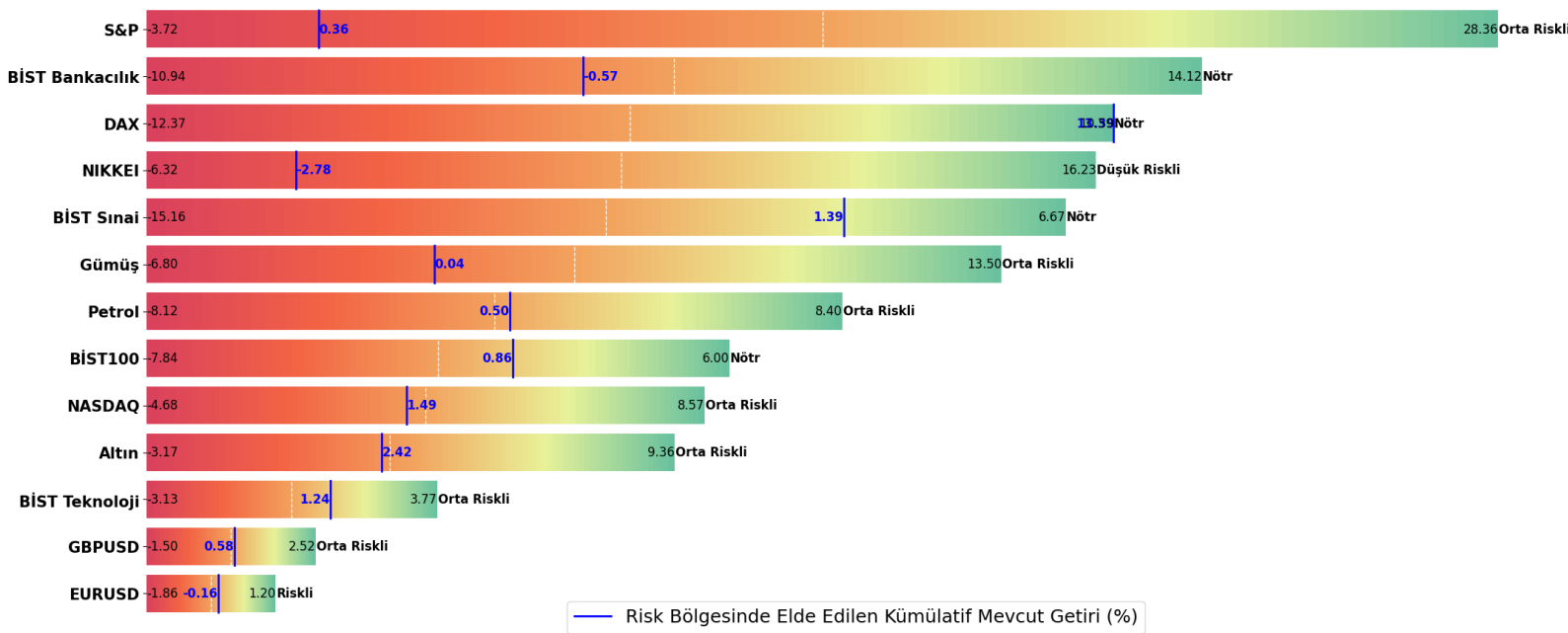
Riskli bölgede bulunan EURUSD modeli bu hafta ve 1 aylık dönemde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda EURUSD paritesi **%1.5 değer kazanmıştır**. EURUSD parite performansı riskli bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde** yer almaktadır.

Bu hafta **63** Bir hafta önce **75** Bir ay önce **93**

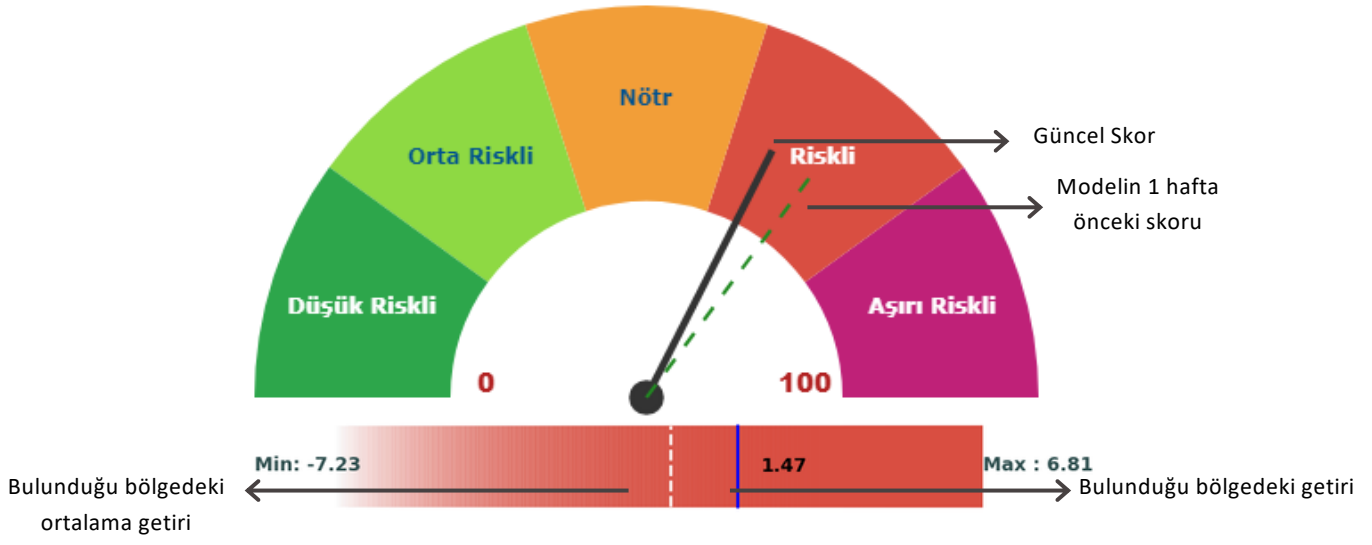


Bulduğu Bölgeye Göre Getiri Bantları



*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 renk ile 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."