

RİSKOMETRE

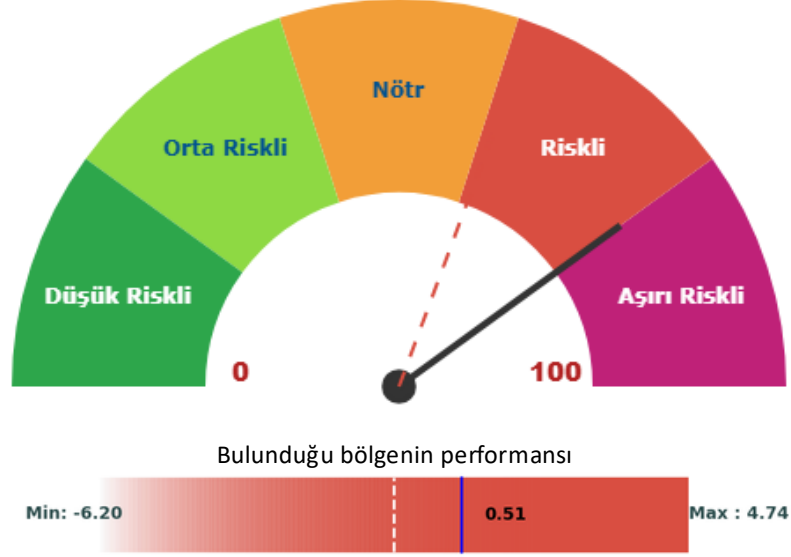
BİST100

13 - 19 Ocak 2025

BİST100 Modeli bu hafta **riskli bölge** içinde aşırı riskli bölge sınırına ilerlemiştir.

BİST100 Endeksi 1 ayda aşırı riskli yöne ilerlerken **yaklaşık %1 değer kaybı** yaşamıştır. Model riskli bölgeye girdiğinden beri BİST100 Endeksi performansı, bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır.**

Bu hafta **80** Bir hafta önce **61** Bir ay önce **58**

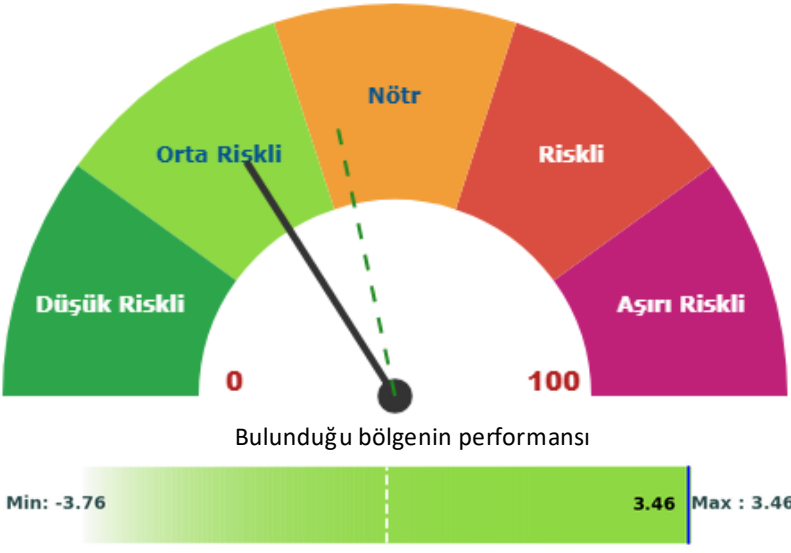


BİST TEKNOLOJİ

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

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada BİST Teknoloji Endeksi **yaklaşık %3.5 değer kazanmıştır.** BİST Teknoloji Endeksi getiri performansı orta riskli bölgedeki **tarihsel maksimum değerine ulaşmıştır.**

Bu hafta **32** Bir hafta önce **43** Bir ay önce **17**

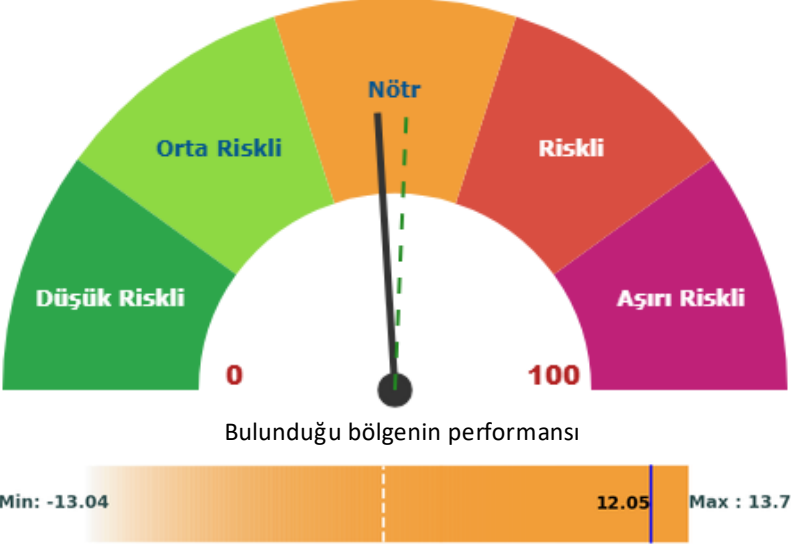


BİST BANKACILIK

1 aylık dönemde **nötr bölge** içinde yer alan BİST Bankacılık modeli düşük riskli yöne ilerlemiştir.

BİST Bankacılık Endeksi, modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda yaklaşık **%4 değer kazanmıştır.** BİST Bankacılık Endeksi performansı model nötr bölgeye girdiğinden beri bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır.**

Bu hafta **45** Bir hafta önce **47** Bir ay önce **48**



BİST SINAI

BİST Sınai modeli 1 aylık dönemde **orta riskli** bölge içinde dalgalanmaktadır.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 ayda BİST Sınai Endeksi **yaklaşık %2.5 değer kaybetmiştir.** Model bu bölgeye girdiğinden beri BİST Sınai Endeksi performansı orta riskli bölgedeki tarihsel **ortalamasının altında seyretmektedir.**

Bu hafta **37** Bir hafta önce **38** Bir ay önce **30**

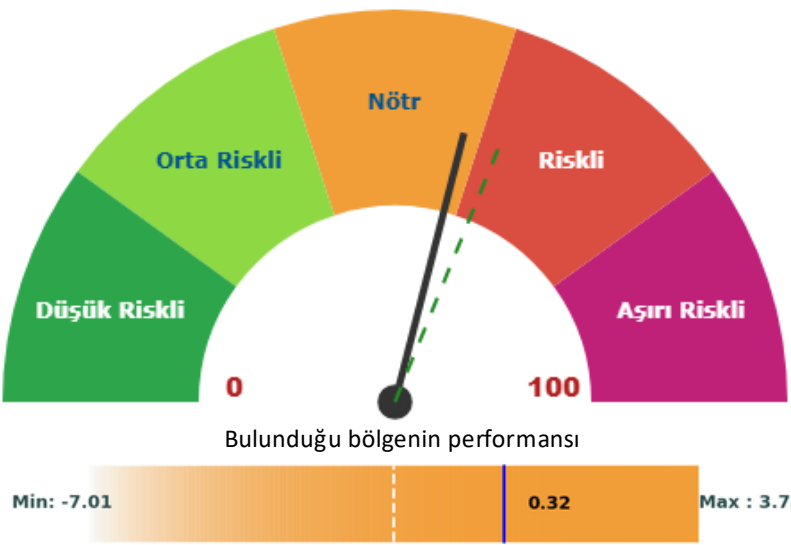


ALTIN

Altın modeli bu hafta riskli bölgeden **nötr bölgeye** dönüş yapmıştır.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada Altın fiyatları **yaklaşık %1.4 değer kazanmıştır.** Model nötr bölgeye girdiğinden beri Altının getirisi bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde yer almaktadır.**

Bu hafta **58** Bir hafta önce **62** Bir ay önce **52**



RİSKOMETRE

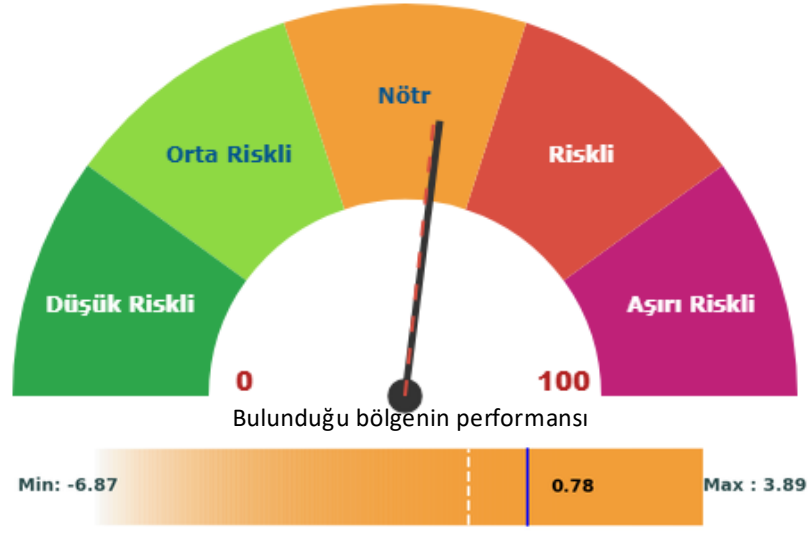
S&P

13 - 19 Ocak 2025

ABD Hisse Senedi modeli 1 haftalık dönemde **nötr bölgede** bulunurken 1 aylık dönemde riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 ayda S&P Endeksi **yaklaşık %3 değer kaybetmiştir**. Model nötr bölgeye girdiğinden beri S&P Endeksinin performansı, bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır**.

Bu hafta **54** Bir hafta önce **53** Bir ay önce **17**

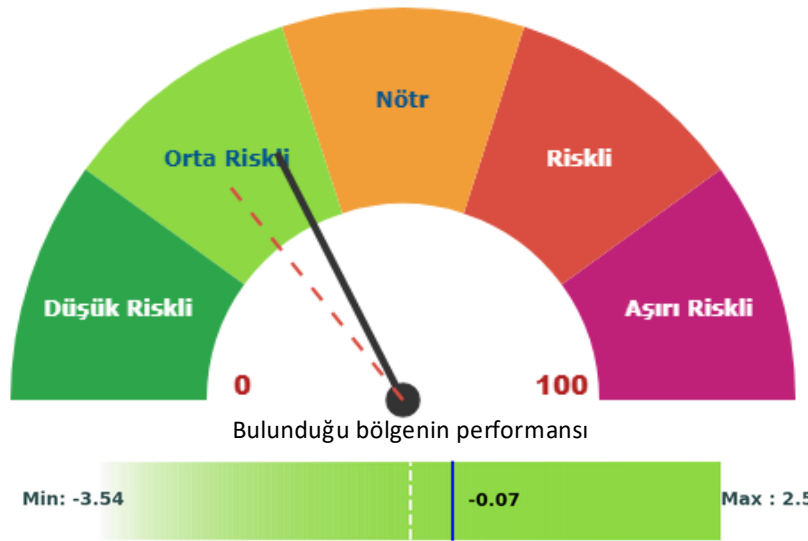


NASDAQ

1 aylık dönemde düşük riskli bölgeden **orta riskli bölgeye** geçen Nasdaq Modeli bu hafta da riskli yöne ilerlemeye devam etmiştir.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 ayda endeks yaklaşık **%2.7 değer kaybetmiştir**. Model orta riskli bölgeye girdiğinden beri endeksin getirisi bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde yer almaktadır**.

Bu hafta **35** Bir hafta önce **28** Bir ay önce **18**

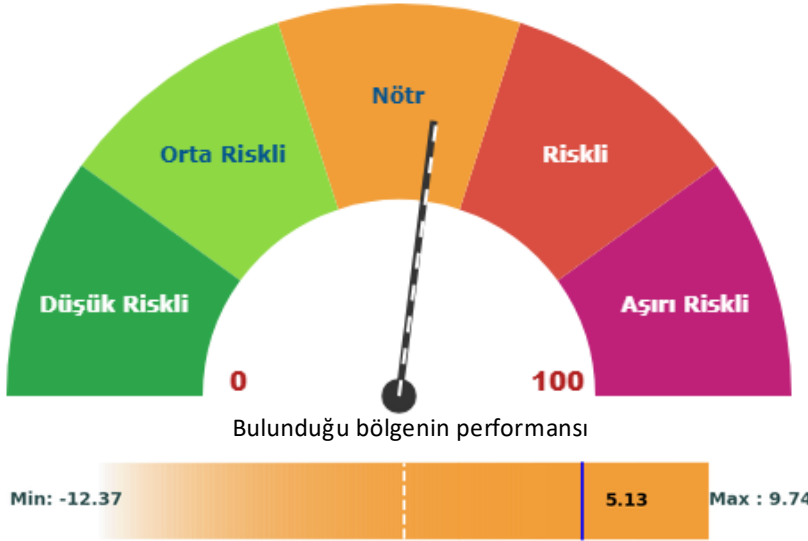


DAX

1 ayda **nötr bölge** içinde riskli yöne ilerleyen Almanya Hisse Senedi modeli bu hafta konumunu korumuştur.

DAX Endeksi modelin nötr sinyal verdiği 1 haftada **yaklaşık %1.5 değer kazanmıştır**. DAX Endeksi performansı nötr bölgeye girdiğinden beri bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır**.

Bu hafta **54** Bir hafta önce **54** Bir ay önce **44**



NIKKEI

1 aylık dönemde **düşük riskli** bölgede yer alan Japonya Hisse Senedi modeli 1 ay önceki konumuna dönüş yapmıştır.

Nikkei Endeksi modelin düşük riskli sinyali verdiği 1 ayda **yaklaşık %1 değer kaybetmiştir**. Nikkei Endeksinin getirisi düşük riskli bölgeye girdiğinden beri bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında bulunmaktadır**.

Bu hafta **14** Bir hafta önce **20** Bir ay önce **14**

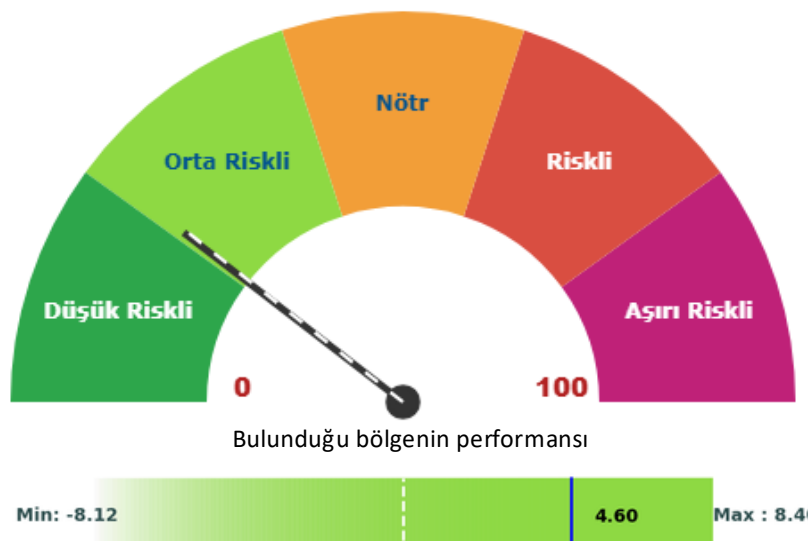


PETROL

1 aylık dönemde düşük riskli yöne ilerleyen Petrol modeli bu hafta **orta riskli** bölge içinde stabil seyretmiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda petrol fiyatları **yaklaşık %4.5 değer kazanmıştır**. Model orta riskli bölgeye girdiğinden beri petrolün getirisi bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır**.

Bu hafta **21** Bir hafta önce **21** Bir ay önce **42**



RİSKOMETRE

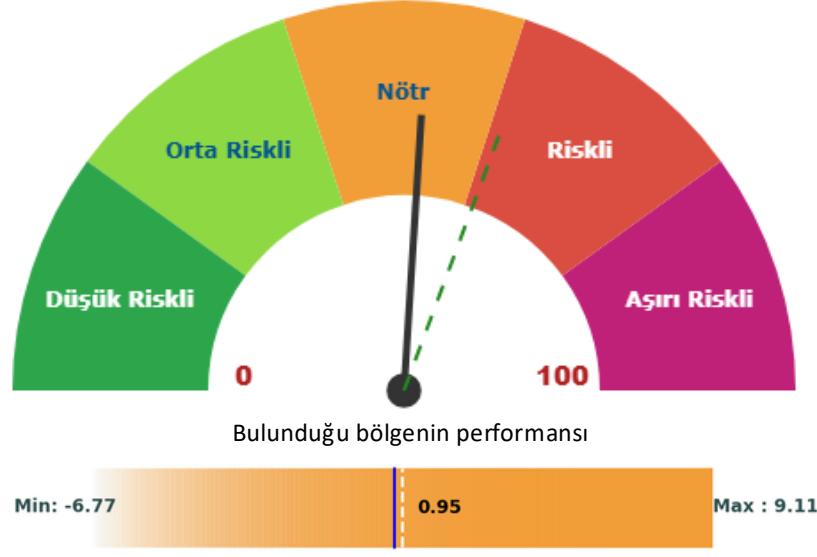
GÜMÜŞ

13 - 19 Ocak 2025

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

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada Gümüş fiyatları yaklaşık **%2 değer kazanmıştır**. Gümüşün getiri performansı bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının hafif altında** bulunmaktadır.

Bu hafta **52** Bir hafta önce **61** Bir ay önce **42**

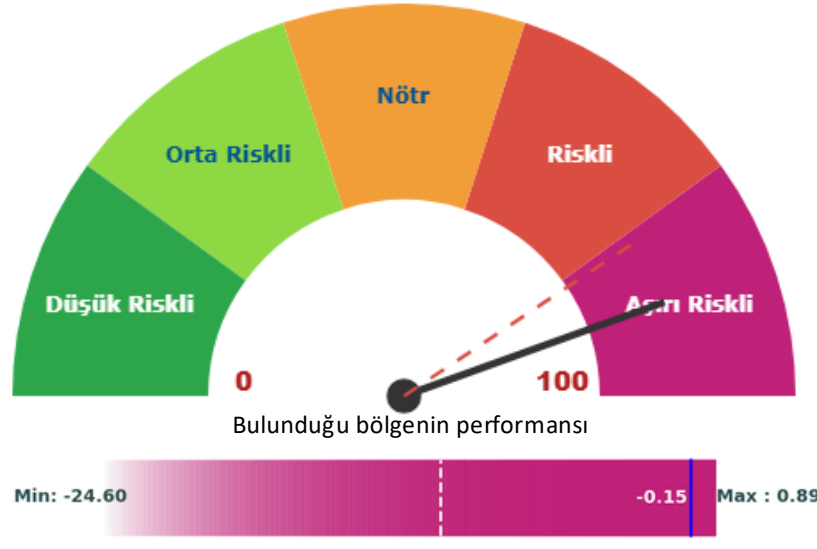


GBPUSD

GBPUSD modeli 1 aylık dönemde **aşırı riskli** yöne ilerlemiştir.

GBPUSD paritesi modelin aşırı riskli yöne ilerlediği 1 ayda **%2.6 değer kaybetmiştir**. GBPUSD parite getirisi aşırı riskli bölgeye girdiğinden beri bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde** yer almaktadır.

Bu hafta **89** Bir hafta önce **81** Bir ay önce **69**

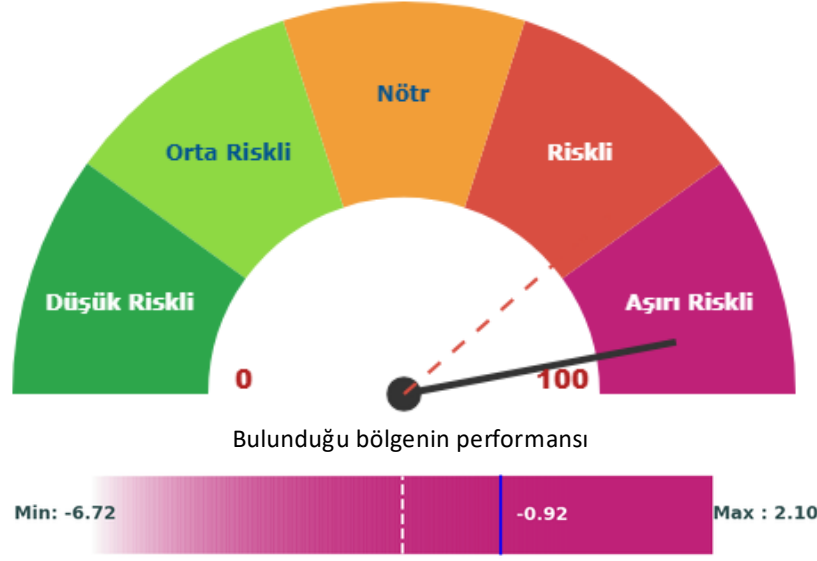


EURUSD

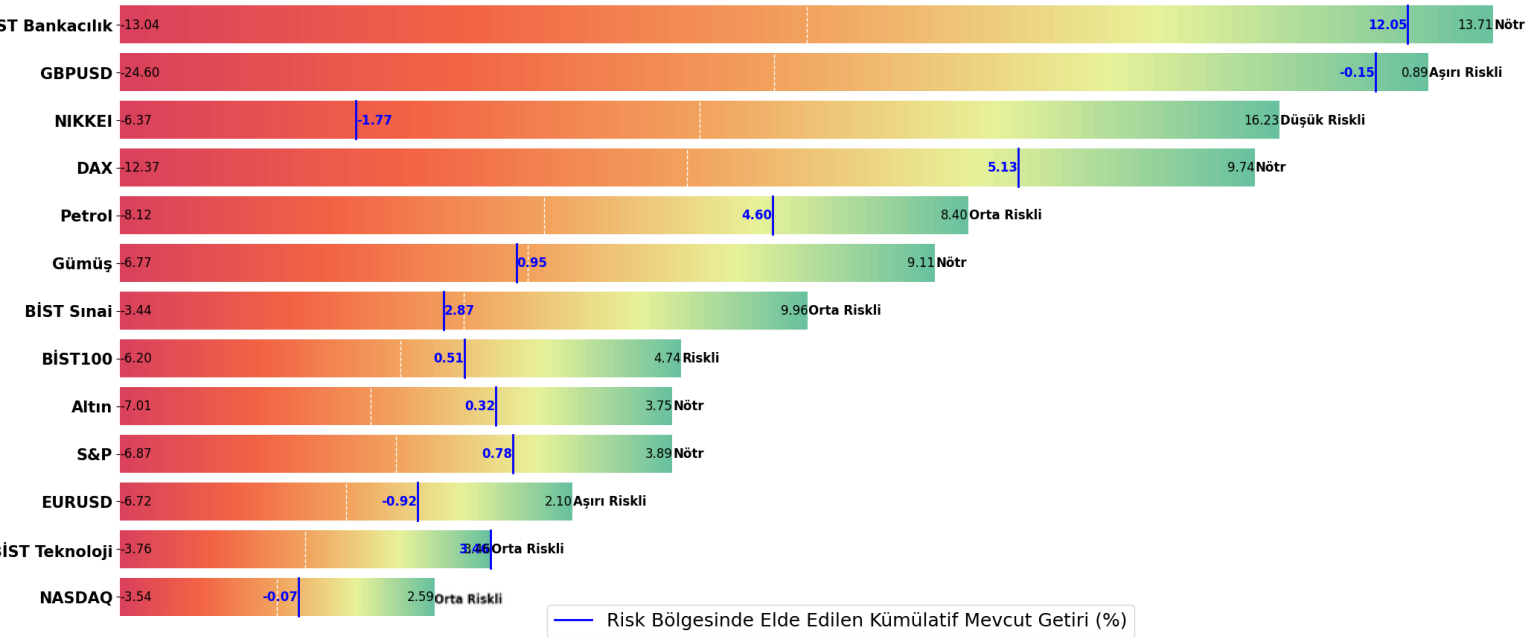
EURUSD modeli 1 aylık dönemde nötr bölgeden **aşırı riskli** bölgeye geçiş yapmıştır.

Modelin aşırı riskli yöne ilerlediği 1 ayda EURUSD paritesi yaklaşık **%2 değer kaybetmiştir**. Parite performansı aşırı riskli bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde** bulunmaktadır.

Bu hafta **94** Bir hafta önce **79** Bir ay önce **57**

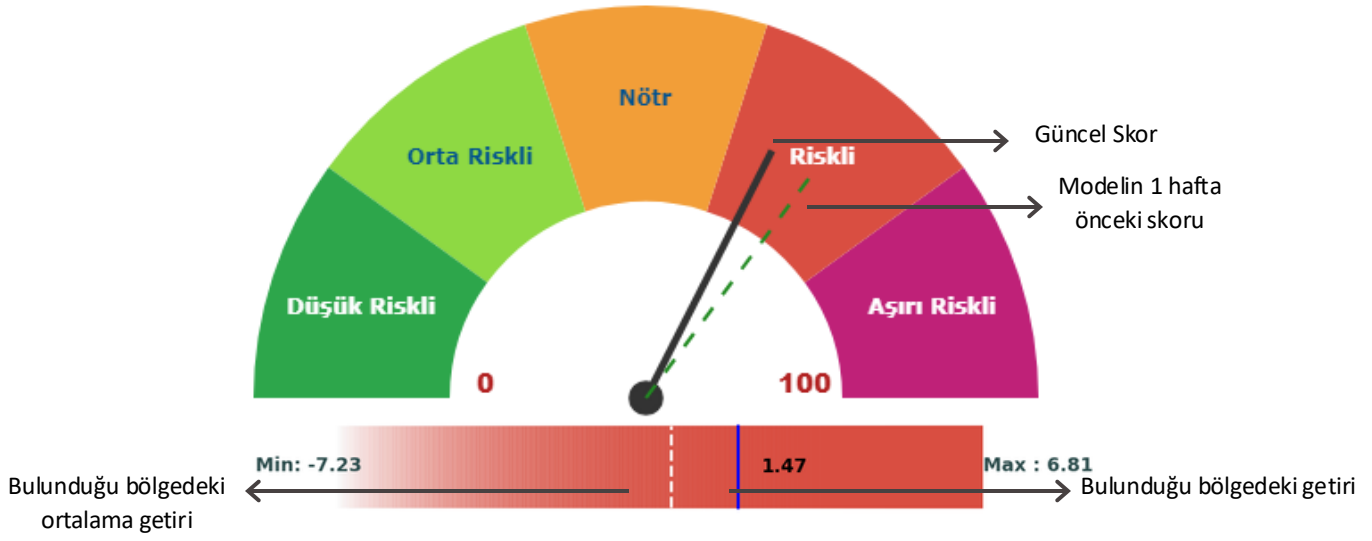


Bulduğu Bölgeye Göre Getiri Bantları



*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:



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.”