

RİSKOMETRE

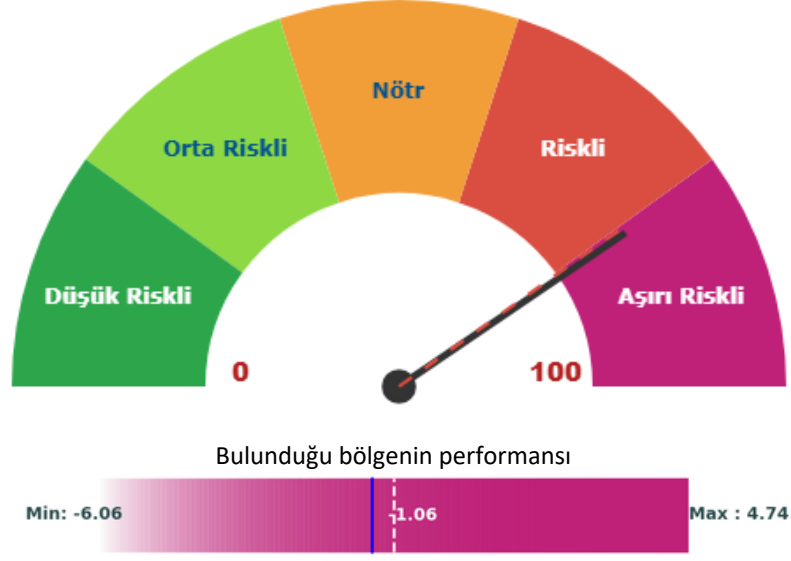
BİST100

20 - 26 Ocak 2025

BİST100 Modeli bu hafta riskli bölgeden **aşırı riskli** bölgeye geçiş yapmıştır.

Model 1 haftada aşırı riskli yöne ilerlerken BİST100 Endeksi **yaklaşık %1.5 değer kaybı** yaşamıştır. Model aşırı riskli bölgeye girdiğinden beri BİST100 Endeksi performansı, bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında bulunmaktadır.**

Bu hafta **81** Bir hafta önce **80** Bir ay önce **59**

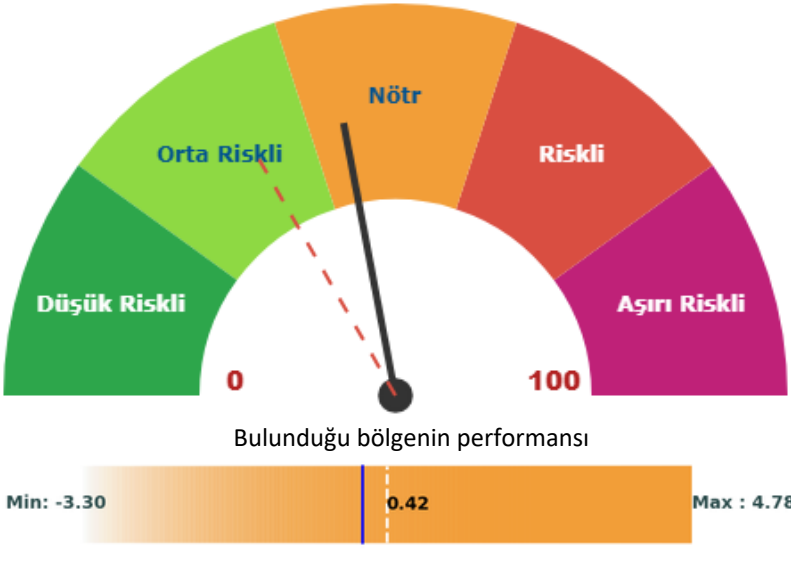


BİST TEKNOLOJİ

BİST Teknoloji modeli bu hafta riskli yöne ilerleyerek orta riskli bölgeden **nötr bölgeye** geçiş yapmıştır.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftada BİST Teknoloji Endeksi **yaklaşık %1 değer kaybetmiştir.** BİST Teknoloji Endeksi getiri performansı nötr bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında yer almaktadır.**

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

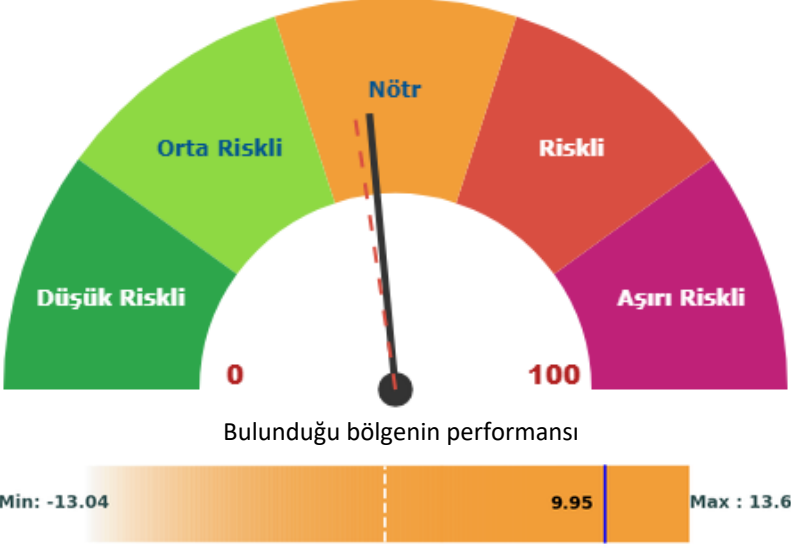


BİST BANKACILIK

1 ayda **nötr bölge içinde** düşük riskli yöne ilerleyen BİST Bankacılık modeli bu hafta riskli yöne ilerlemiştir.

BİST Bankacılık Endeksi, modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda **%5.5 değer kazanmıştır.** BİST Bankacılık Endeksi performansı model nötr bölgeye girdiğinden beri bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır.**

Bu hafta **47** Bir hafta önce **45** Bir ay önce **51**



BİST SINAI

BİST Sınai Modeli 1 haftalık ve 1 aylık dönemde **orta riskli** bölge içinde riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftada BİST Sınai Endeksi **%1.25 değer kaybı yaşamıştır.** Model bu bölgeye girdiğinden beri BİST Sınai Endeksi performansı orta riskli bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde seyretmektedir.**

Bu hafta **40** Bir hafta önce **37** Bir ay önce **31**

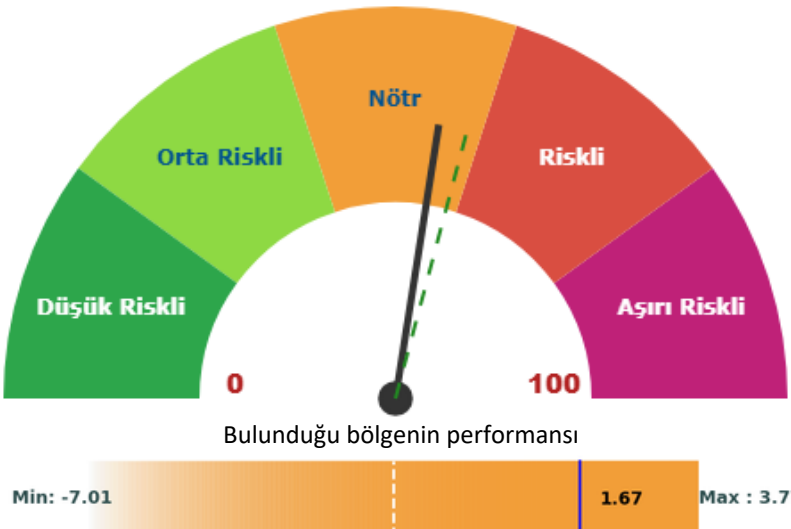


ALTIN

Altın modeli bu hafta, geçen hafta geçiş yaptığı **nötr bölge** içinde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 aylık dönemde Altın fiyatları **yaklaşık %3.5 değer kazanmıştır.** Model nötr bölgeye girdiğinden beri Altının getirisi bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde yer almaktadır.**

Bu hafta **55** Bir hafta önce **58** Bir ay önce **68**



RİSKOMETRE

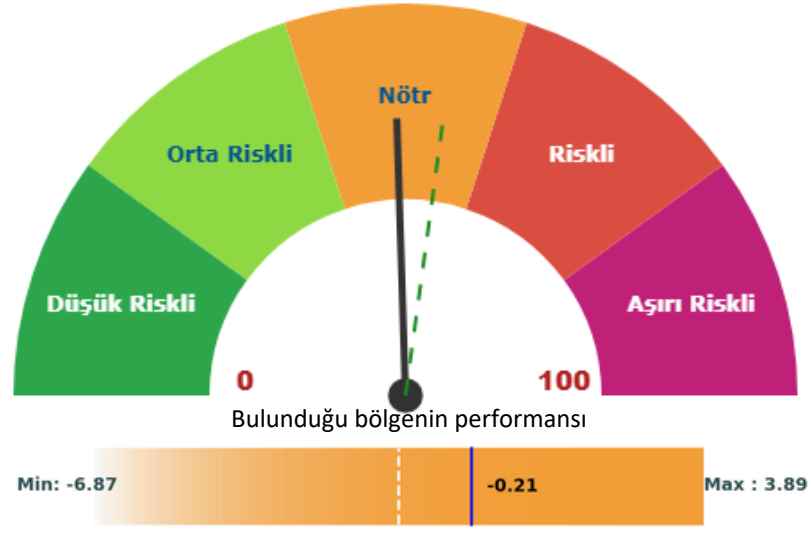
S&P

20 - 26 Ocak 2025

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

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda S&P Endeksi **%1.2 değer kazanmıştır**. Model nötr bölgeye girdiğinden beri S&P Endeksinin performansı, bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır**.

Bu hafta **49** Bir hafta önce **54** Bir ay önce **56**

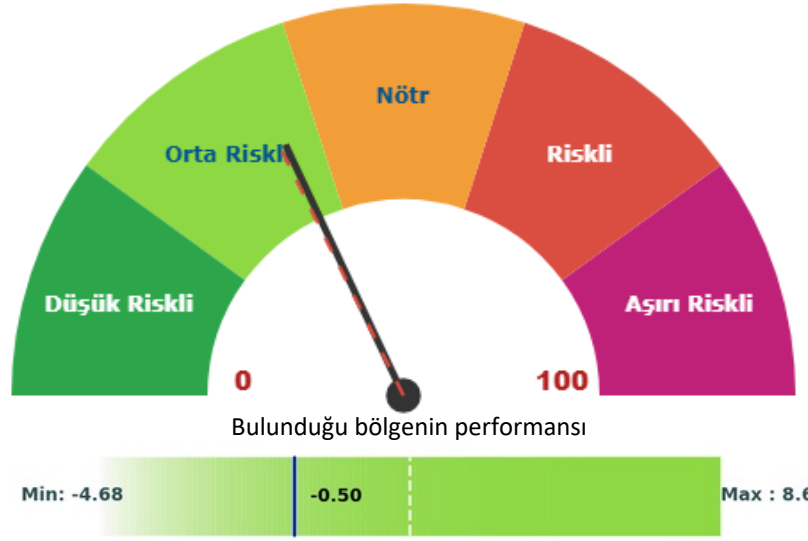


NASDAQ

Nasdaq Modeli 1 aylık ve 1 haftalık dönemde **orta riskli bölgede** yer alırken riskli yöne ilerlemiştir.

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

Bu hafta **36** Bir hafta önce **35** Bir ay önce **31**

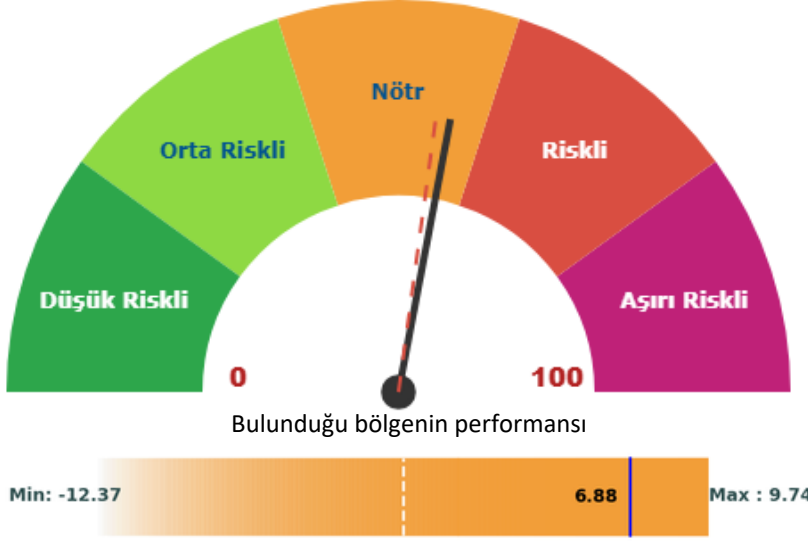


DAX

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

Modelin riskli yöne ilerlemesine rağmen DAX Endeksi 1 ayda **yaklaşık %3.5 değer kazanmıştır**. DAX Endeksi performansı nötr bölgeye girdiğinden beri bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır**.

Bu hafta **56** Bir hafta önce **54** Bir ay önce **46**

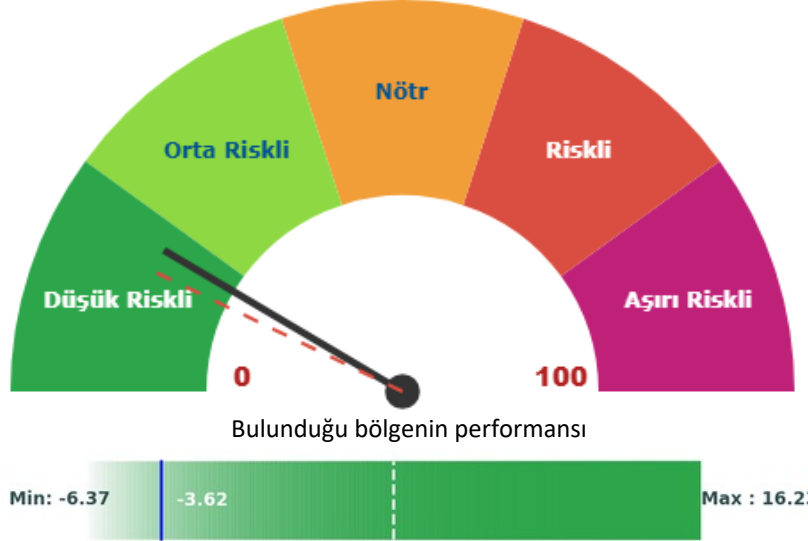


NIKKEI

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

Nikkei Endeksi modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftada **yaklaşık %1.9 değer kaybetmiştir**. Nikkei Endeksinin getirisi düşük riskli bölgeye girdiğinden beri bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında bulunmaktadır**.

Bu hafta **17** Bir hafta önce **14** Bir ay önce **18**



PETROL

Petrol modeli 1 ayda nötr bölgeden **düşük riskli bölgeye** geçiş yapmıştır.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda petrol fiyatları **yaklaşık %12 getiri sağlamıştır**. Model düşük riskli bölgeye girdiğinden beri petrolün getirisi bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında yer almaktadır**.

Bu hafta **1** Bir hafta önce **21** Bir ay önce **43**



RİSKOMETRE

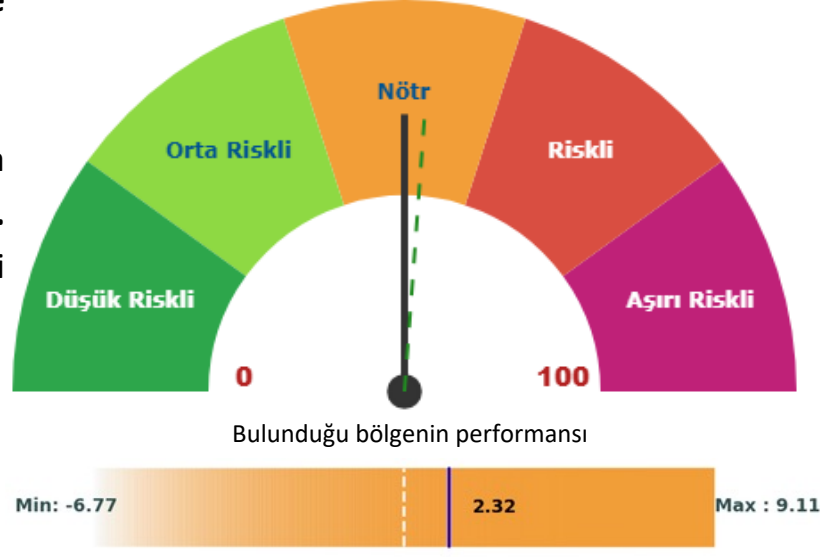
GÜMÜŞ

20 - 26 Ocak 2025

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

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda Gümüş fiyatları **%3.8 değer kazanmıştır**. Gümüşün getiri performansı bu bölgedeki tarihsel ortalamasının üzerindedir.

Bu hafta **50** Bir hafta önce **52** Bir ay önce **59**

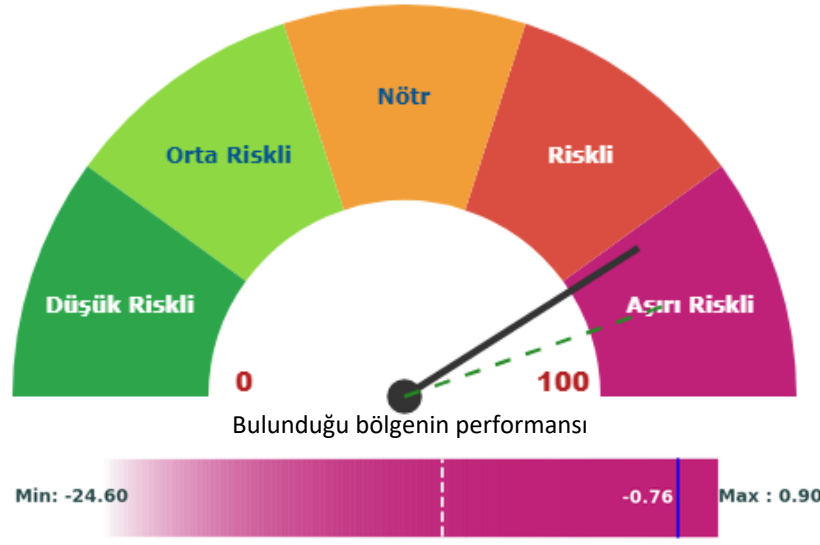


GBPUSD

1 ayda aşırı riskli yöne ilerleyen GBPUSD modeli bu hafta **aşırı riskli bölge** içinde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

GBPUSD paritesi modelin aşırı riskli yöne ilerlediği 1 ayda yaklaşık **%2.9 değer kaybetmiştir**. GBPUSD parite getirisi aşırı riskli bölgeye girdiğinden beri bu bölgedeki tarihsel ortalamasının üzerinde yer almaktadır.

Bu hafta **82** Bir hafta önce **89** Bir ay önce **72**

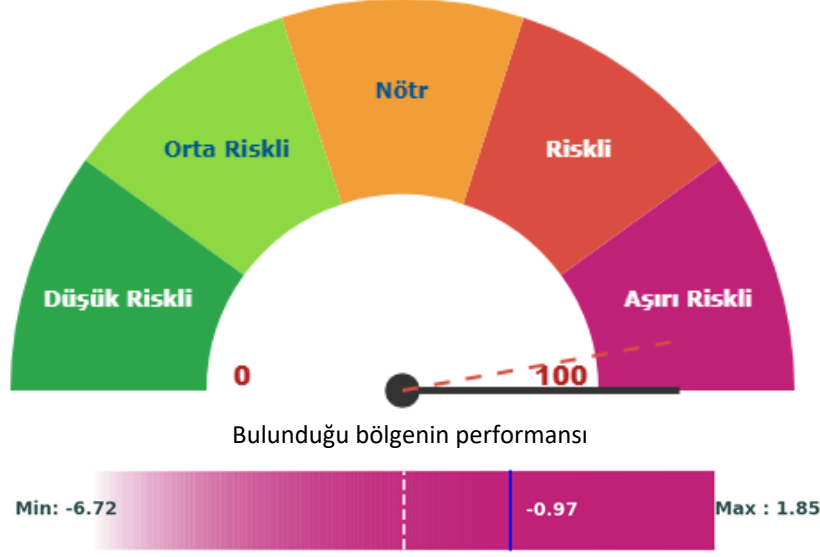


EURUSD

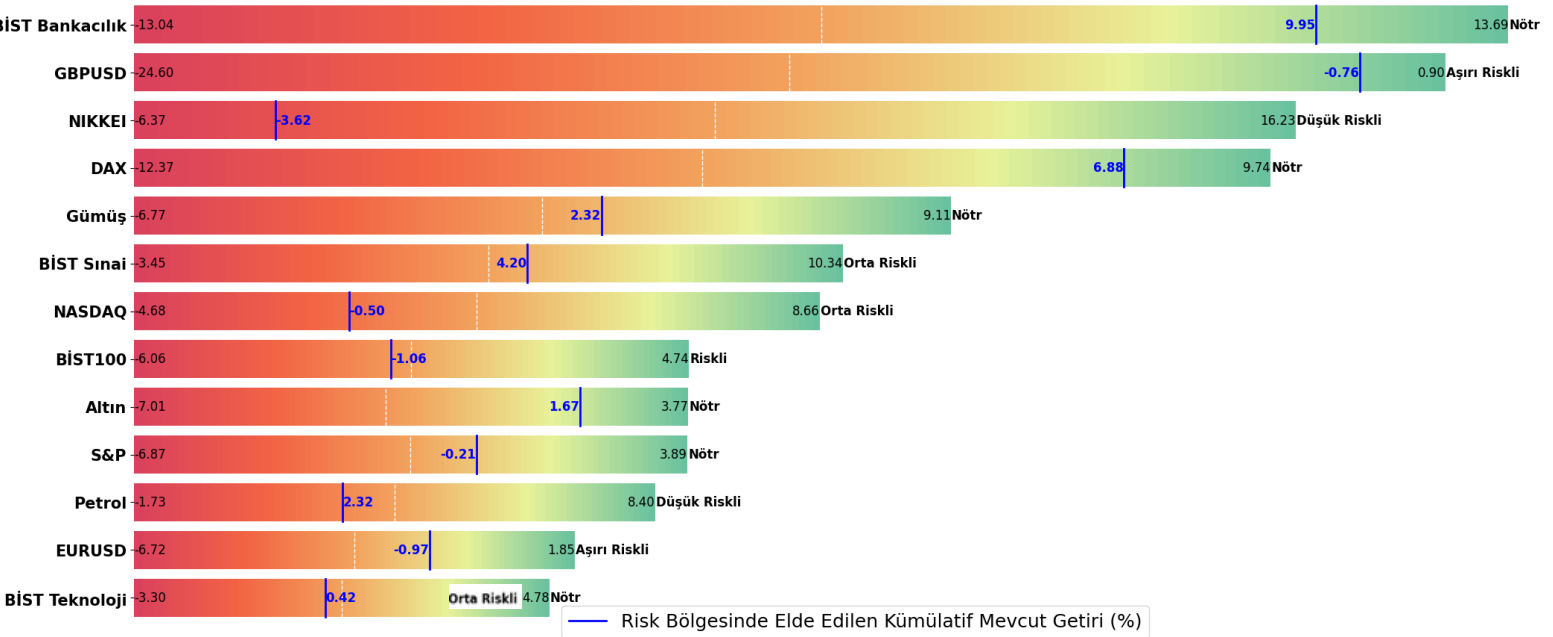
EURUSD modeli bu hafta ve 1 aylık dönemde **aşırı riskli yöne** ilerleyerek **maksimum risk** değerine ulaşmıştır.

Modelin aşırı riskli yöne ilerlediği 1 ayda EURUSD paritesi **%1.35 değer kaybetmiştir**. Parite performansı aşırı riskli bölgedeki tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır.

Bu hafta **100** Bir hafta önce **94** Bir ay önce **60**

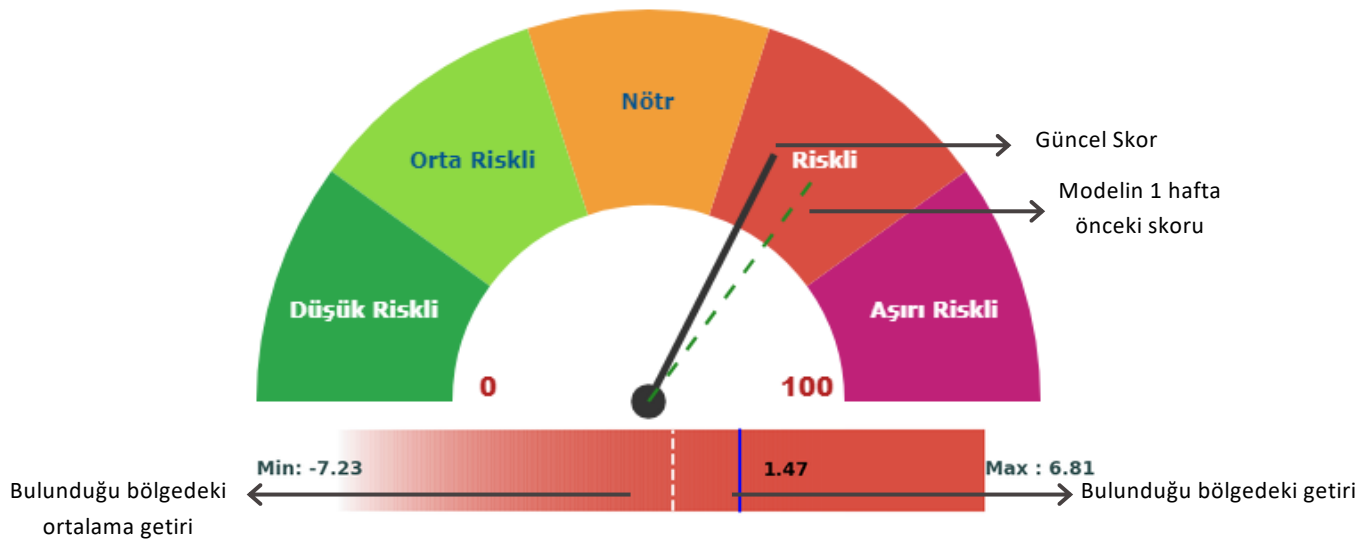


Bulunduğu Bölgeye Göre Getiri Bantları



*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 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."