

RİSKOMETRE

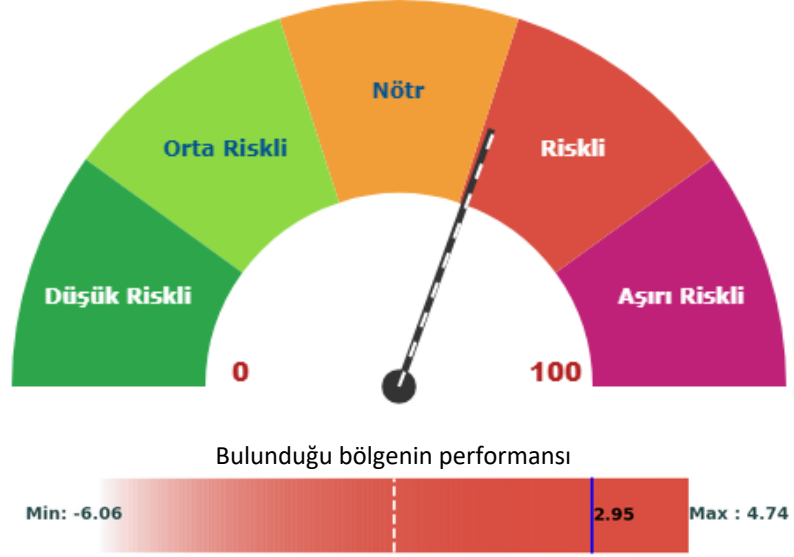
BIST100

6 - 12 Ocak 2025

BIST100 Modeli bu hafta **riskli bölgede konumunu korumuştur.**

BIST100 Endeksi getirisi modelin riskli sinyali verdiği 1 haftada **stabil seyretmiştir.** Model bu bölgeye girdiğinden beri BIST100 Endeksi performansı, bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır.**

Bu hafta **61** Bir hafta önce **61** Bir ay önce **55**

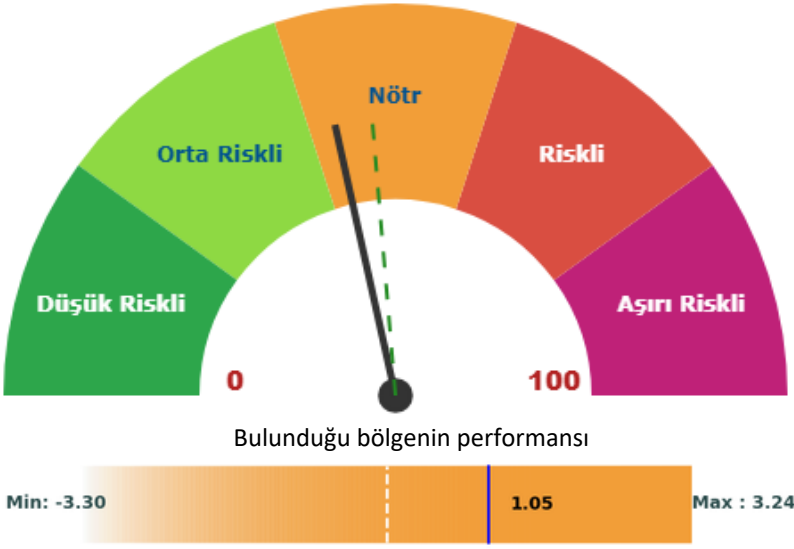


BIST TEKNOLOJİ

1 aylık dönemde riskli yöne ilerleyen BIST Teknoloji modeli bu hafta düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada BIST Teknoloji Endeksi **yaklaşık %0.5 değer kazanmıştır.** BIST Teknoloji Endeksi performansı nötr bölgeye girdiğinden beri **bu bölgedeki tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır.**

Bu hafta **43** Bir hafta önce **47** Bir ay önce **4**

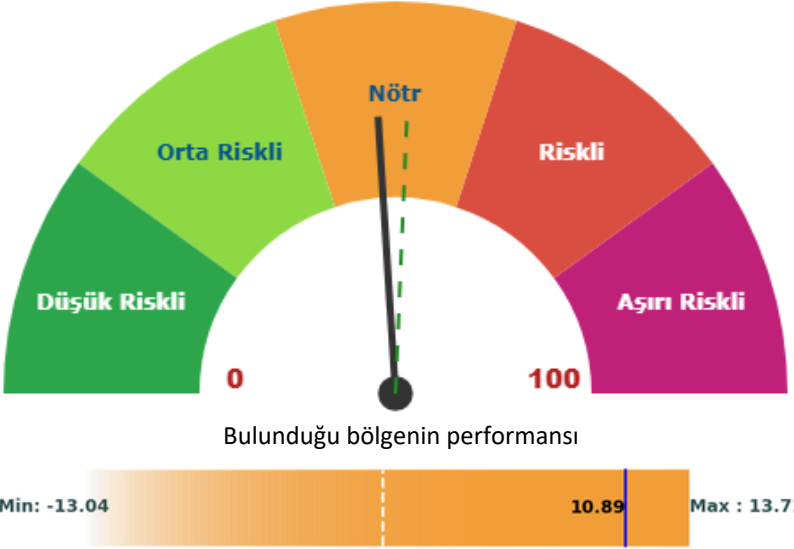


BIST BANKACILIK

1 aylık dönemde **nötr bölge** içinde riskli yöne ilerleyen BIST Bankacılık modeli bu hafta düşük riskli yöne ilerlemiştir.

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

Bu hafta **48** Bir hafta önce **51** Bir ay önce **46**

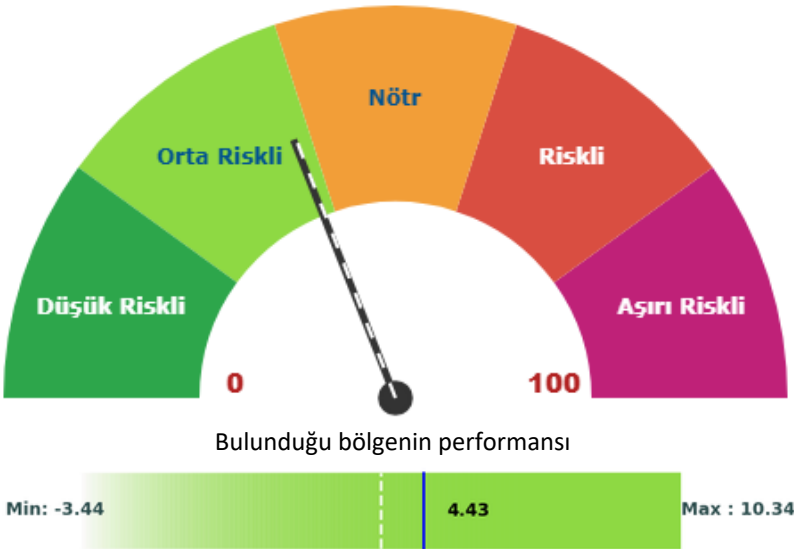


BIST SINAI

BIST Sınai modeli 1 aylık dönemde **orta riskli** bölge içinde riskli yöne ilerlerken bu hafta stabil seyretmiştir.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 ayda BIST Sınai Endeksi **yaklaşık %0.5 değer kaybetmiştir.** Model bu bölgeye girdiğinden beri BIST Sınai Endeksi performansı bölgedeki tarihsel **ortalamasının üzerinde seyretmektedir.**

Bu hafta **38** Bir hafta önce **38** Bir ay önce **34**

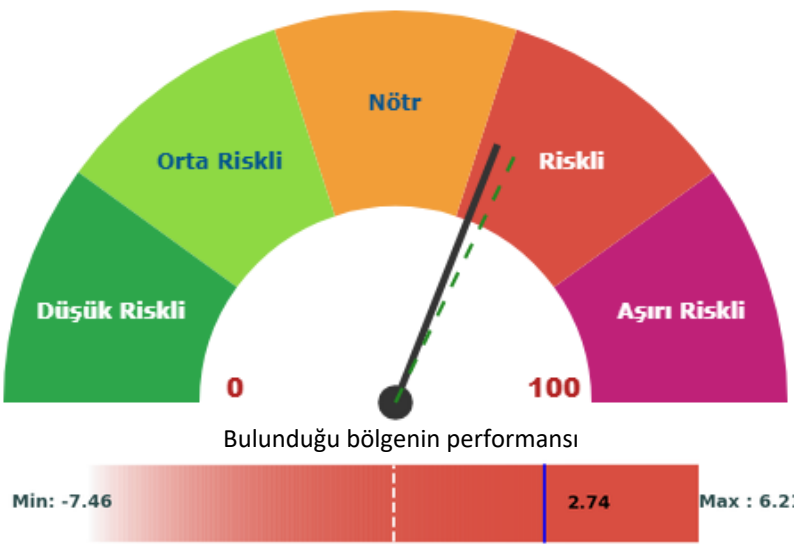


ALTIN

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

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada Altın fiyatları **yaklaşık %1.5 değer kazanmıştır.** Model riskli bölgeye girdiğinden beri Altının getirisi bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde yer almaktadır.**

Bu hafta **62** Bir hafta önce **64** Bir ay önce **48**



RİSKOMETRE

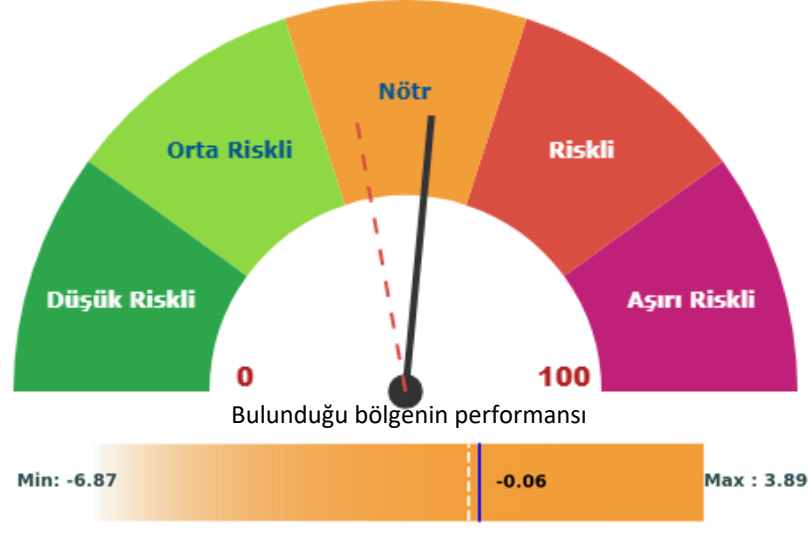
S&P

6 - 12 Ocak 2025

ABD Hisse Senedi modeli bu hafta **nötr bölge** içinde riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftada S&P Endeksi **%1.7 düşüş yaşamıştır**. Model nötr bölgeye girdiğinden beri S&P Endeksinin performansı, bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır**.

Bu hafta **53** Bir hafta önce **43** Bir ay önce **22**

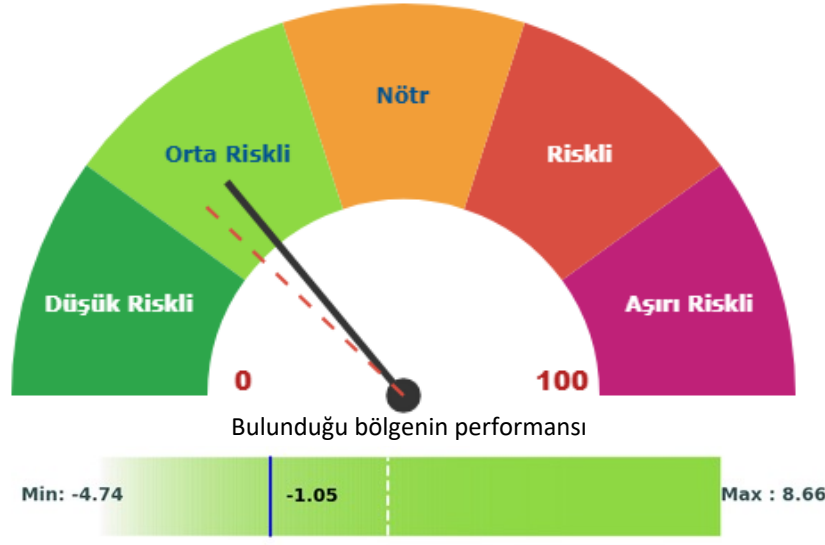


NASDAQ

1 aylık dönemde riskli yöne ilerleyen NASDAQ modeli bu hafta da **orta riskli bölge** içinde riskli yöne ilerlemiştir.

Model 1 haftada riskli yöne ilerlerken endeks yaklaşık **%3.7 değer kaybetmiştir**. Model orta riskli bölgeye girdiğinden beri endeksin getirisi bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında yer almaktadır**.

Bu hafta **28** Bir hafta önce **24** Bir ay önce **14**

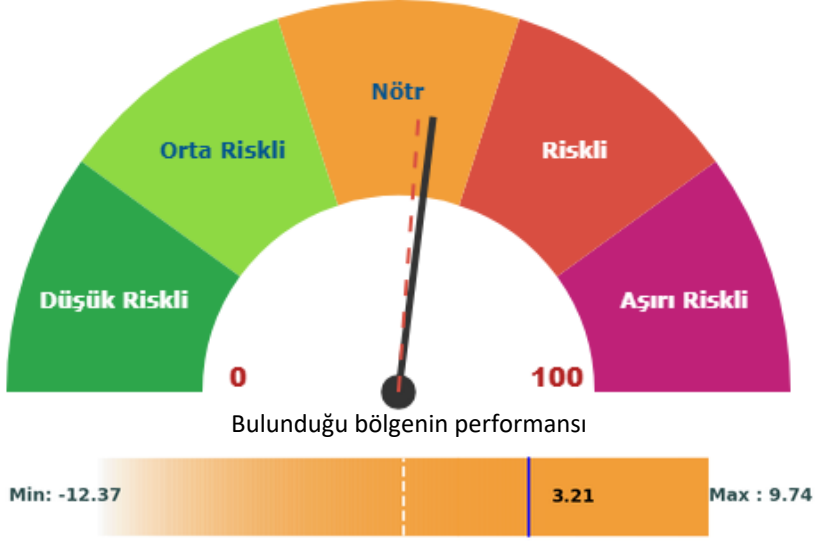


DAX

Almanya Hisse Senedi modeli 1 haftalık ve 1 aylık dönemde **nötr bölge** içinde riskli yöne ilerleyişini sürdürmüştür.

DAX Endeksi modelin riskli yöne ilerlediği 1 ayda **yaklaşık %2 değer kaybetmiştir**. DAX Endeksi performansı nötr bölgeye girdiğinden beri bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır**.

Bu hafta **54** Bir hafta önce **52** Bir ay önce **48**

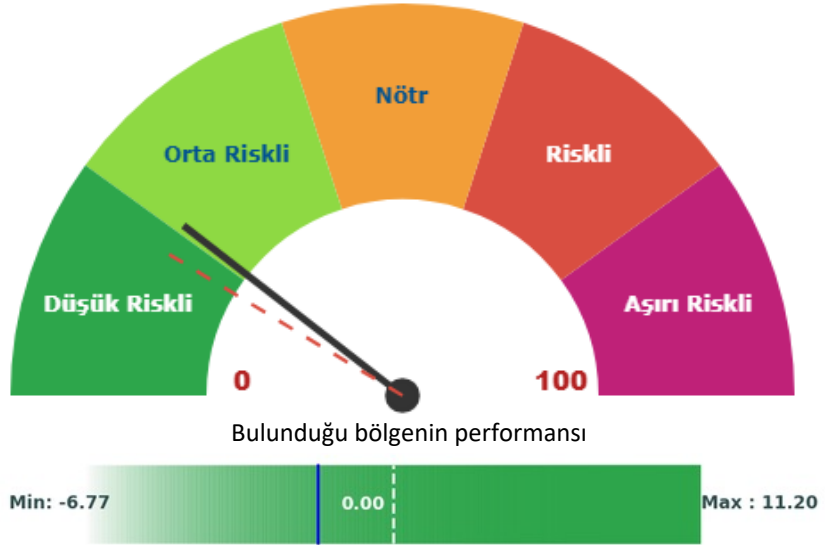


NIKKEI

1 ayda düşük riskli yöne ilerleyen Japonya Hisse Senedi modeli bu hafta **düşük riskli bölge** içinde riskli yöne ilerlemiştir.

Nikkei Endeksi, modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda **yaklaşık %4 değer kazanmıştır**. Nikkei Endeksinin getirisi düşük riskli bölgeye girdiğinden beri bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında bulunmaktadır**.

Bu hafta **19** Bir hafta önce **17** Bir ay önce **21**

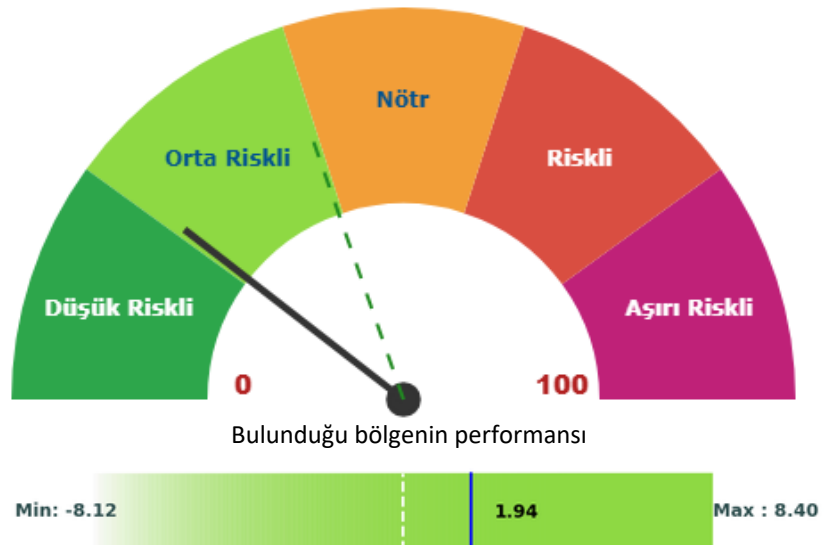


PETROL

Petrol modeli 1 aylık sürede düşük riskli yöne ilerleyerek nötr bölgeden **orta riskli bölge** alt sınırına geçiş yapmıştır.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda petrol fiyatları **yaklaşık %6.5 değer kazanmıştır**. Model bu bölgeye girdiğinden beri petrolün getirisi bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır**.

Bu hafta **21** Bir hafta önce **39** Bir ay önce **56**



RİSKOMETRE

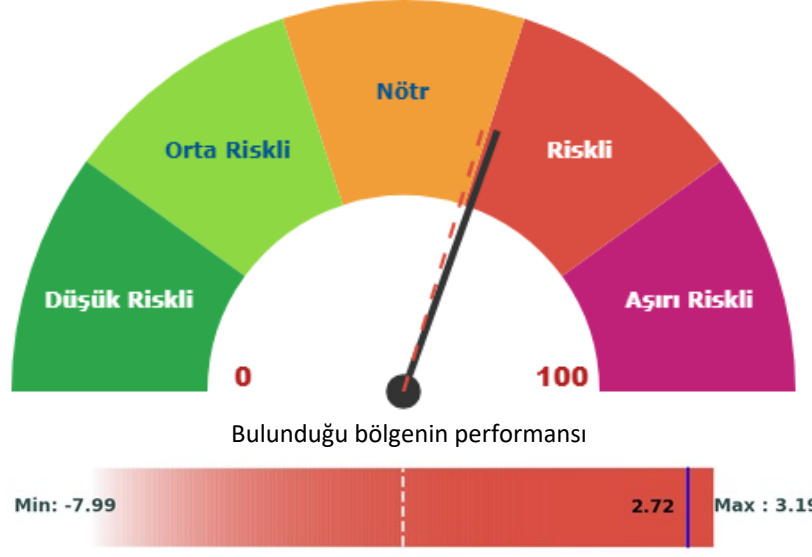
GÜMÜŞ

6 - 12 Ocak 2025

1 haftalık ve 1 aylık dönemde riskli yöne ilerleyen Gümüş modeli ve bu hafta **riskli bölgeye** geçiş yapmıştır.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 ayda Gümüş fiyatları yaklaşık **%4 değer kaybetmiştir**. Gümüşün getiri performansı bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır**.

Bu hafta **61** Bir hafta önce **59** Bir ay önce **40**

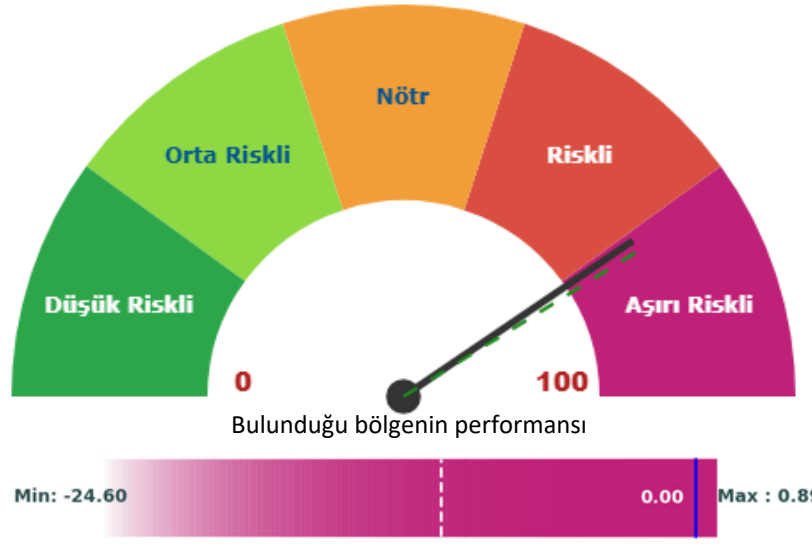


GBPUSD

GBPUSD modeli 1 aylık dönemde **aşırı riskli** yöne ilerlerken bu hafta aşırı riskli bölge içinde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

GBPUSD paritesi modelin aşırı riskli yöne ilerlediği 1 ayda **%2.75 değer kaybetmiştir**. GBPUSD parite getirisi aşırı riskli bölgeye girdiğinden beri bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde yer almaktadır**.

Bu hafta **81** Bir hafta önce **82** Bir ay önce **63**

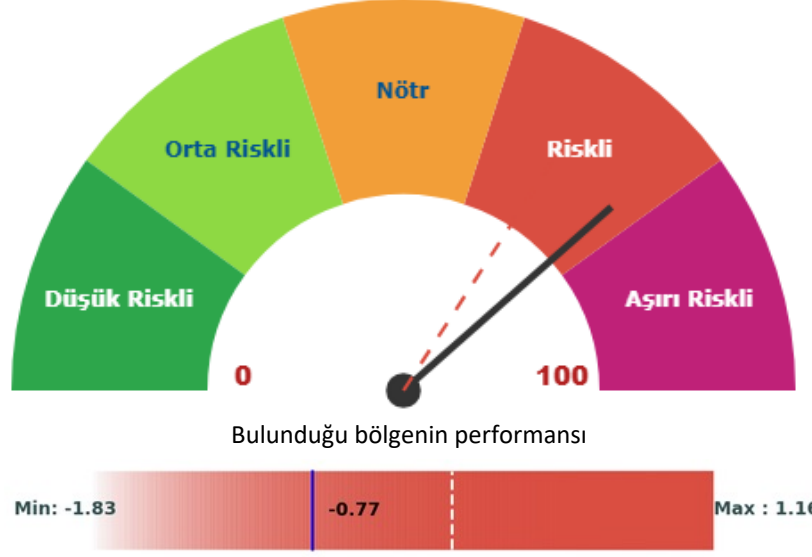


EURUSD

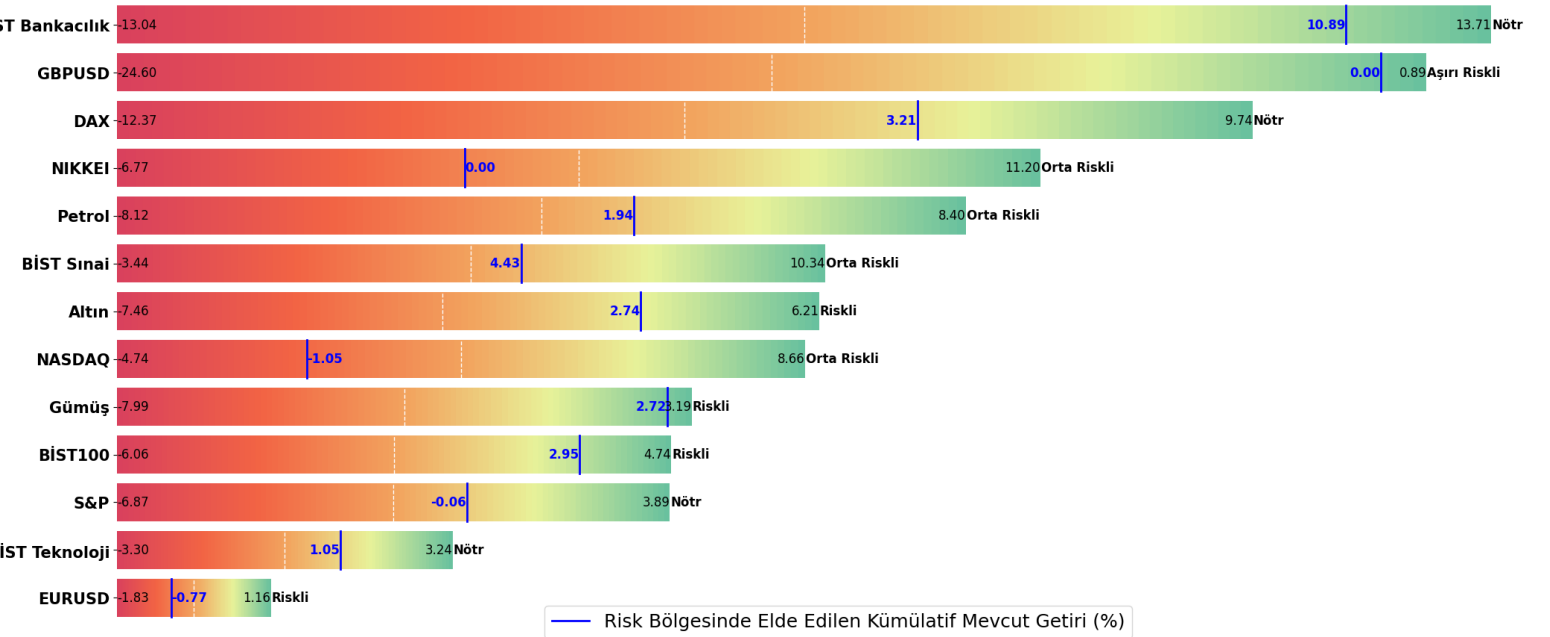
EURUSD modeli riskli bölgede kalmaya devam ediyor.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 ayda EURUSD paritesi yaklaşık **%3 değer kaybetmiştir**. Parite performansı riskli bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında bulunmaktadır**.

Bu hafta **77** Bir hafta önce **68** Bir ay önce **60**

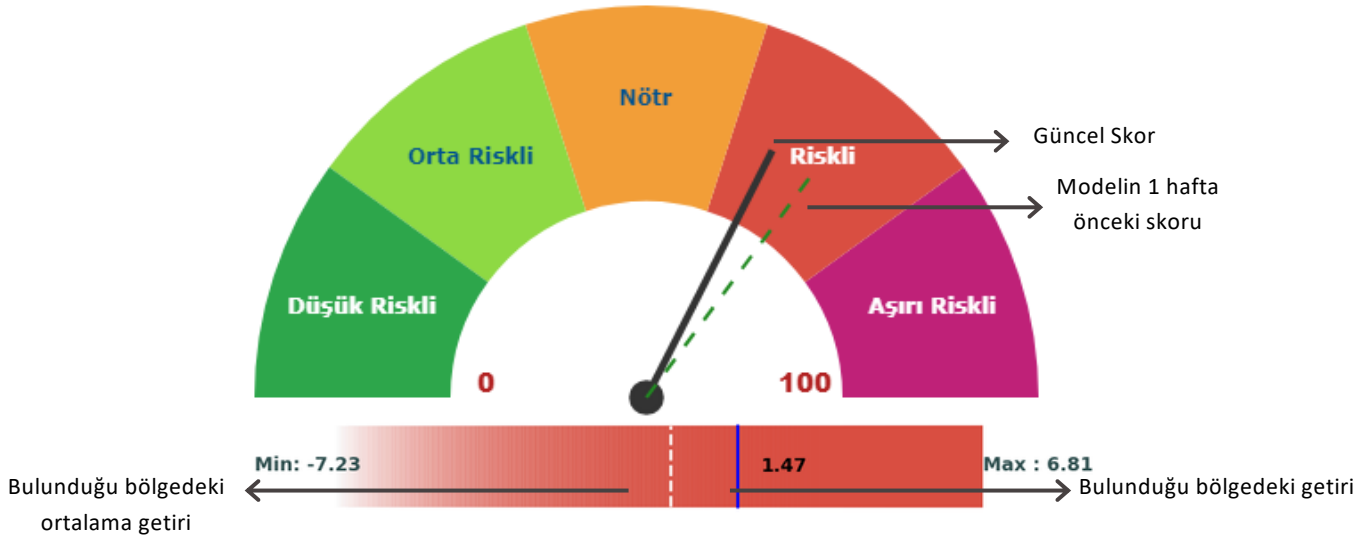


Bulduğu Bölgeye Göre Getiri Bantları



*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."