

RİSKOMETRE

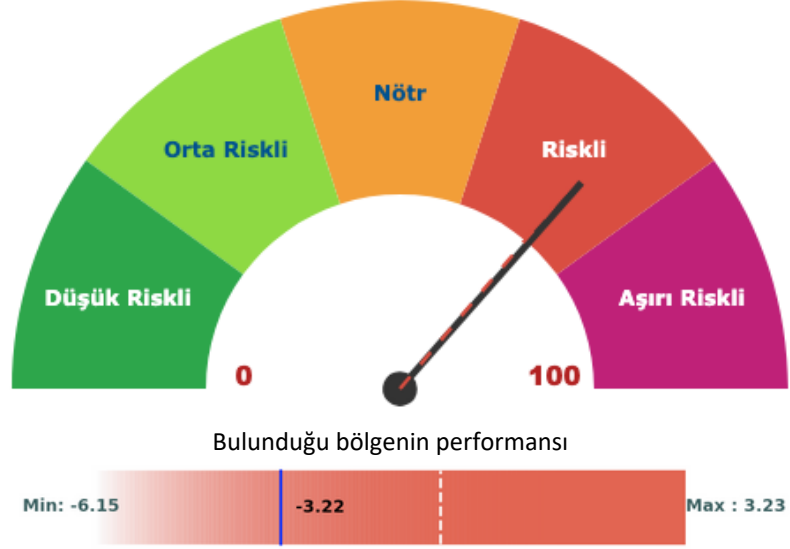
BİST100

14 - 20 Nisan 2025

BİST100 modeli bu hafta **riskli** bölgede bulunmaya devam etmektedir

Modelin riskli bölgede bulunduğu 1 haftalık dönemde BİST100 Endeksi yaklaşık **%1 değer kaybetmiştir**. Model riskli bölgeye girdiğinden beri BİST100 Endeksi performansı, bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında bulunmaktadır**.

Bu hafta **73** Bir hafta önce **72** Bir ay önce **100**

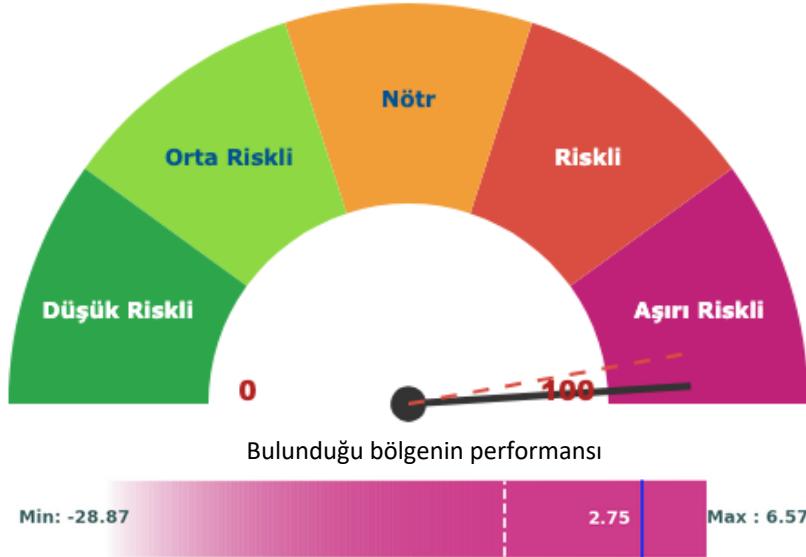


BİST TEKNOLOJİ

BİST Teknoloji modeli 1 aylık dönemde **aşırı riskli bölgede** yer almaktadır.

Modelin aşırı riskli sinyali verdiği 1 ayda BİST Teknoloji Endeksi **yaklaşık %1 değer kazanmıştır**. BİST Teknoloji Endeksi getiri performansı aşırı riskli bölgedeki **tarihsel ortalamasının üstünde bulunmaktadır**.

Bu hafta **98** Bir hafta önce **94** Bir ay önce **100**

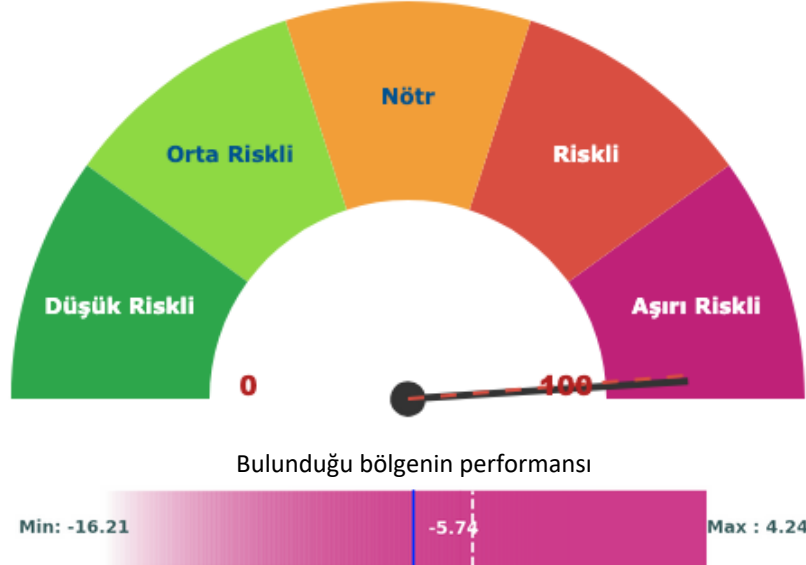


BİST BANKACILIK

BİST Bankacılık modeli 1 aylık dönemde **aşırı riskli bölgede** bulunmaktadır.

BİST Bankacılık Endeksi, modelin aşırı risk sinyali verdiği 1 ayda **%31 değer kaybetmiştir**. Model bu bölgeye girdiğinden beri endeksin performansı bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında bulunmaktadır**.

Bu hafta **98** Bir hafta önce **97** Bir ay önce **100**

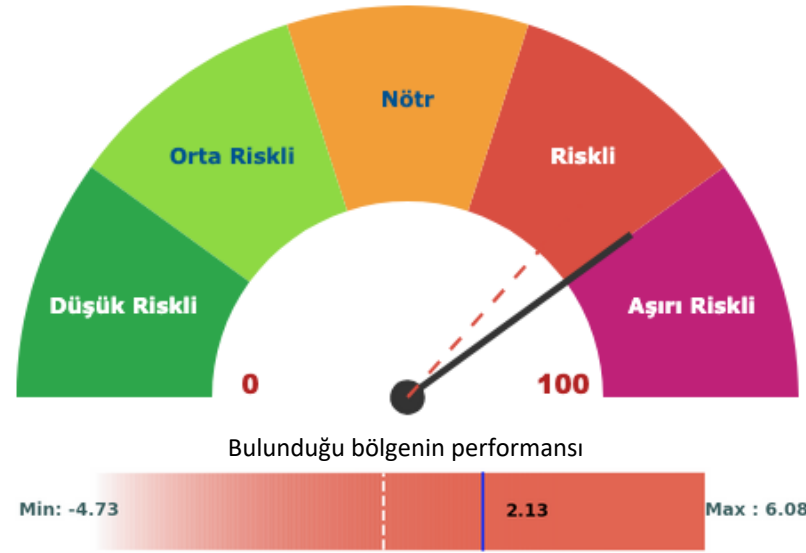


BİST SİNAİ

BİST Sınai modeli bu hafta **riskli bölgede** aşırı riskli yönde ilerlemiştir

Modelin aşırı riskli yönde ilerlediği 1 haftada endeks **yaklaşık %1 değer kaybetmiştir**. Model riskli bölgeye girdiğinden beri BİST Sınai Endeksi performansı bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde yer almaktadır**.

Bu hafta **80** Bir hafta önce **73** Bir ay önce **100**

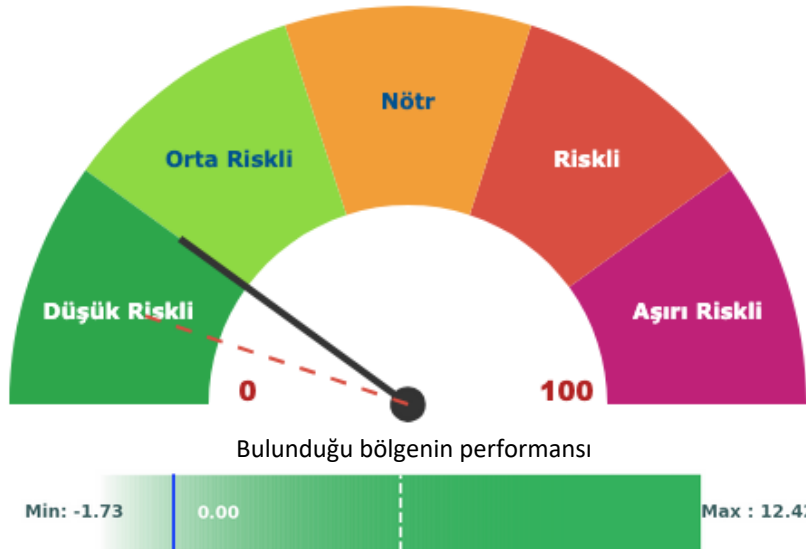


ALTIN

Altın modeli bu hafta **düşük riskli** bölgede orta riskli bölge sınırına ilerlemiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda Altın fiyatları **yaklaşık %6 değer kazanmıştır**. Model düşük riskli bölgeye girdiğinden beri Altının getirisi bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında yer almaktadır**.

Bu hafta **20** Bir hafta önce **10** Bir ay önce **22**



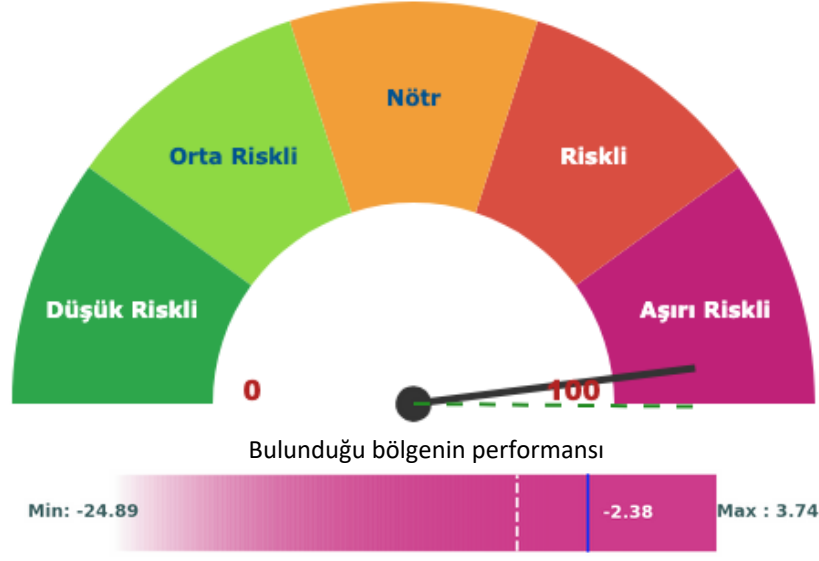
RİSKOMETRE

S&P

14 - 20 Nisan 2025

1 aylık dönemde aşırı riskli yönde ilerleyen ABD Hisse Senedi Modeli bu hafta **aşırı riskli bölgede** bulunmaya devam etmektedir.

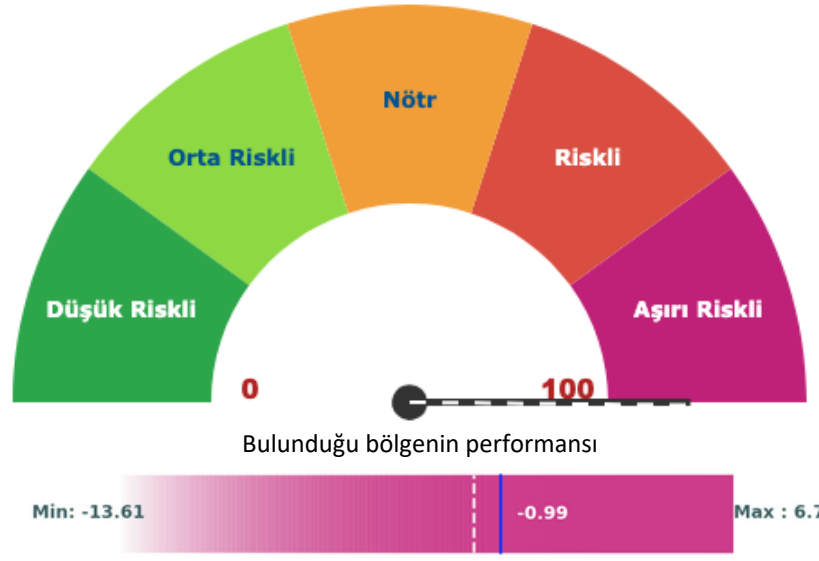
Modelin aşırı riskli yöne ilerlediği 1 ayda endeks yaklaşık **%4.5 değer kaybetmiştir**. Endeksin getiri performansı aşırı riskli bölgeye girdiğinden beri bu bölgedeki **ortalamasının üzerindedir**.



NASDAQ

1 aylık dönemde **aşırı riskli** yönde ilerleyen Nasdaq Modeli bu hafta da **maksimum değerinde** bulunmaktadır.

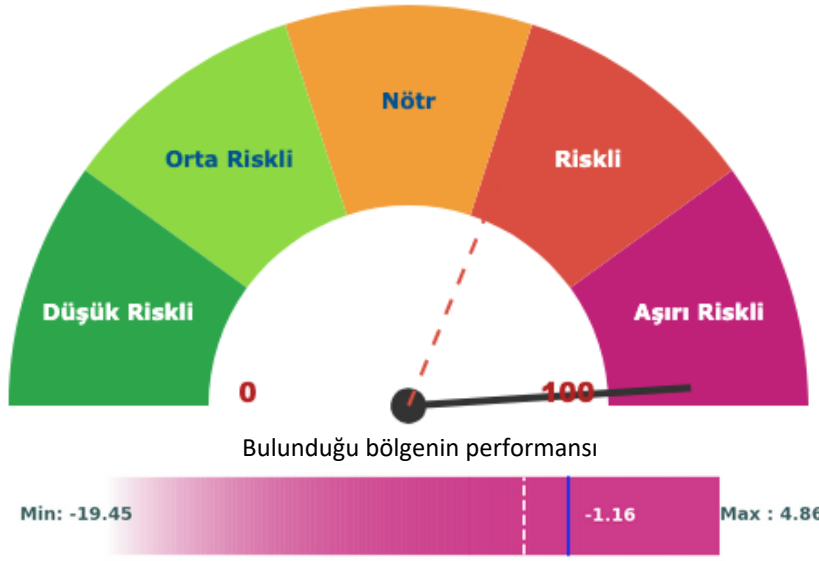
Modelin aşırı riskli yöne ilerlediği 1 ayda endeks yaklaşık **%4.6 değer kaybetmiştir**. Model bu bölgeye girdiğinden beri endeksin getirisi aşırı riskli bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerindedir**.



DAX

1 aylık dönemde aşırı riskli yönde hareket eden Almanya Hisse Senedi Modeli bu hafta **aşırı riskli** bölgede bulunmaktadır.

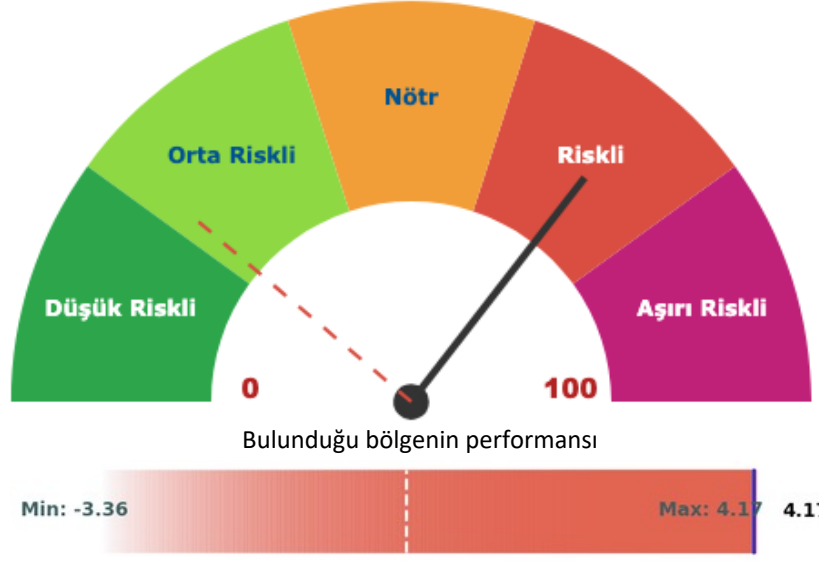
Modelin aşırı riskli yönde ilerlediği 1 ayda DAX Endeksi yaklaşık **%4.8 değer kaybetmiştir**. Model aşırı riskli bölgeye girdiğinden beri endeksin getiri performansı bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerindedir**.



NIKKEI

Japonya Hisse Senedi modeli bu hafta riskli yönde ilerleyerek **riskli bölgeye** geçiş yapmıştır.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 ayda Nikkei Endeksi **yaklaşık %7.3 değer kaybetmiştir**. Endeksin getirisi riskli bölgeye girdiğinden beri bu bölgedeki **tarihsel maksimumuna yakın bir konumda bulunmaktadır**.



PETROL

1 aylık dönemde riskli yöne ilerleyen Petrol modeli bu hafta **riskli** bölgeye geçmiştir.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 ayda petrol fiyatları **yaklaşık %10 değer kaybetmiştir**. Model riskli bölgeye girdiğinden beri petrolün getirisi bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında yer almaktadır**.



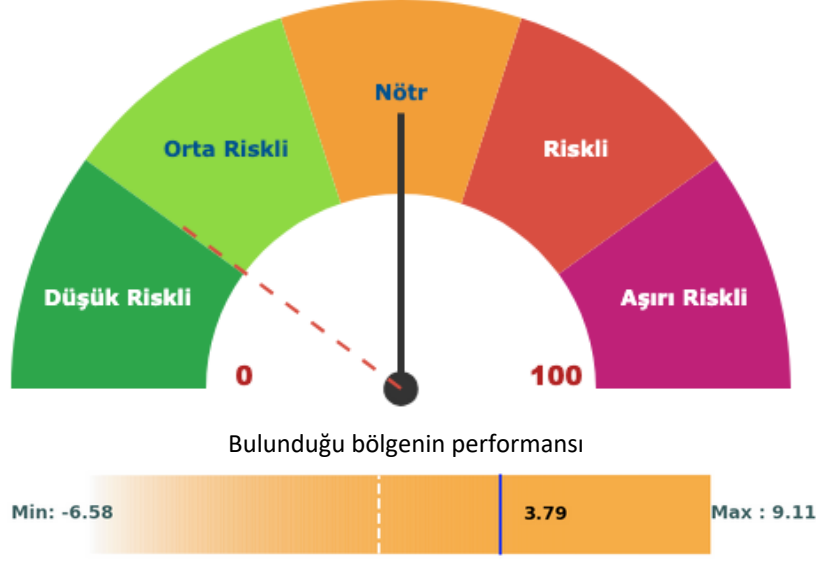
RİSKOMETRE

GÜMÜŞ

14 - 20 Nisan 2025

Gümüş modeli bu hafta riskli yönde ilerleyerek **nötr bölgeye** geçiş yapmıştır.

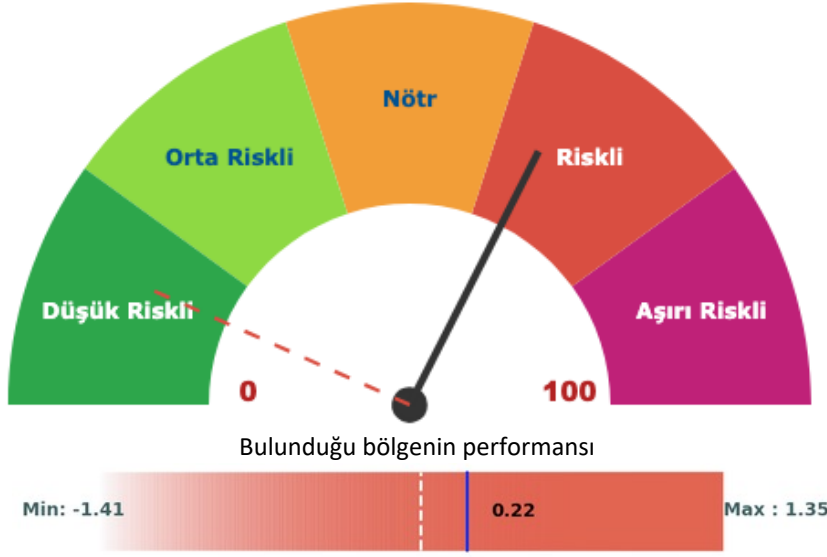
Modelin riskli yöne ilerlediği 1 ayda Gümüş fiyatları yaklaşık **%7.2 değer kaybetmiştir**. Gümüşün getiri performansı nötr bölgedeki **tarihsel ortalamasının üstünde** bulunmaktadır.



GBPUSD

GBPUSD modeli bu hafta **riskli bölgeye** geçiş yapmıştır

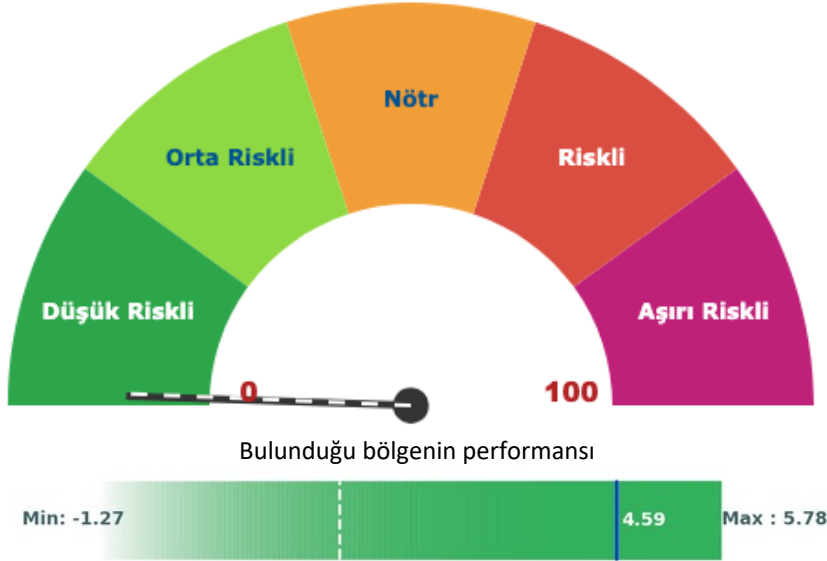
Modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftada parite **değeri sabit kalmıştır**. GBPUSD parite getirisi riskli bölgeye girdiğinden beri bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üstünde** yer almaktadır.



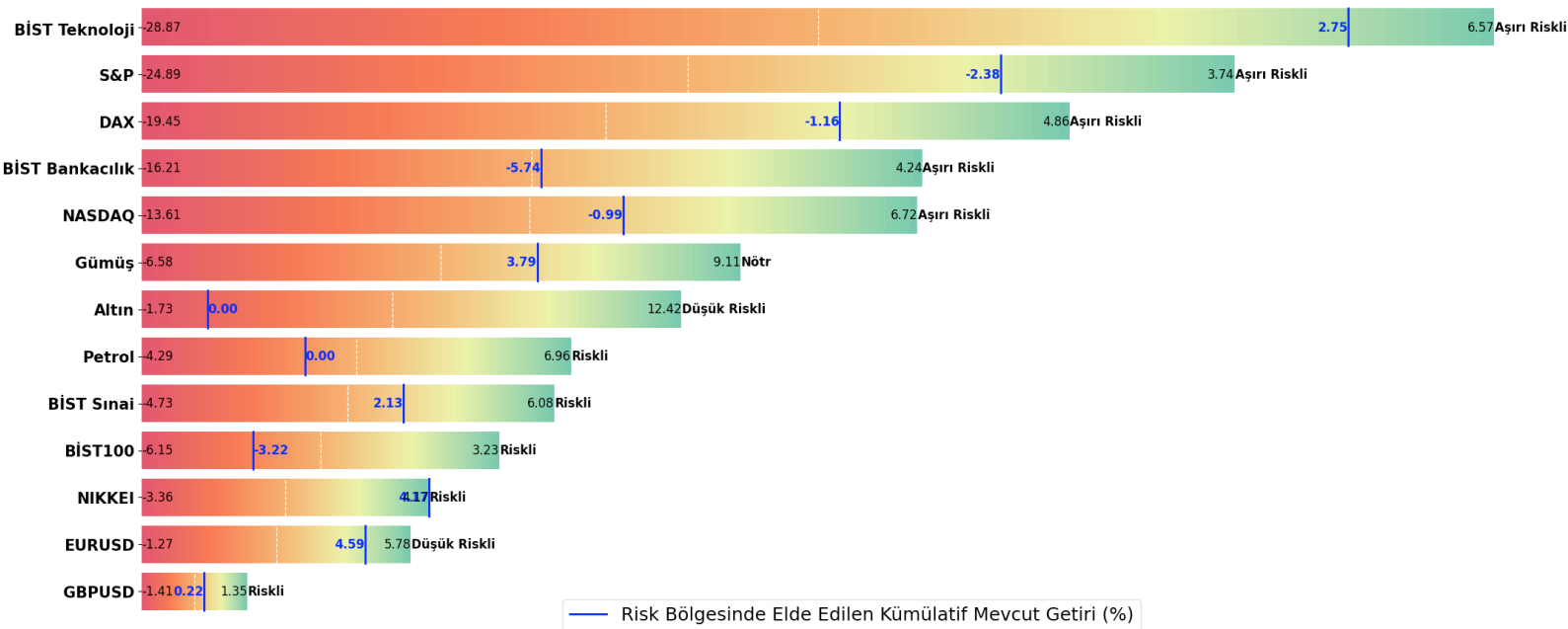
EURUSD

1 aylık dönemde **düşük riskli** bölgede yer alan EURUSD modeli bu hafta da konumunu korumuştur.

Modelin konumunu koruduğu 1 ayda EURUSD paritesi **%5 değer kazanmıştır**. EURUSD parite performansı düşük riskli bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde** yer almaktadır.

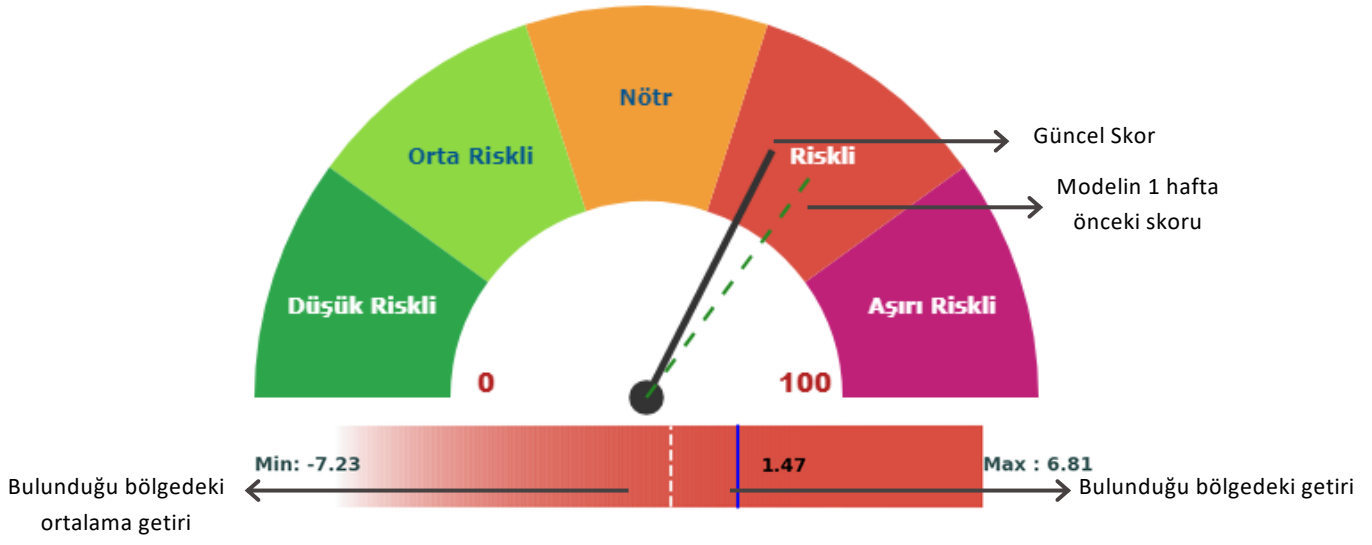


Bulunduğu Bölgeye Göre Getiri Bantları



*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.”