

# RİSKOMETRE

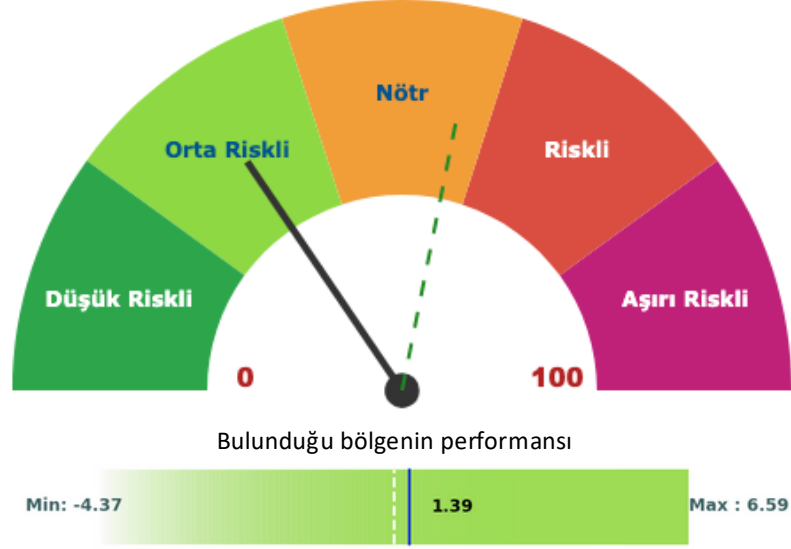
BIST100

17 - 23 Mart 2025

BIST100 modeli bu hafta **orta riskli** bölgeye geçiş yapmıştır.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 aylık dönemde BIST100 Endeksi yaklaşık **%9.7 değer kazanmıştır**. Model orta riskli bölgeye girdiğinden beri BIST100 Endeksi performansı, bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır**.

Bu hafta **31** Bir hafta önce **56** Bir ay önce **64**

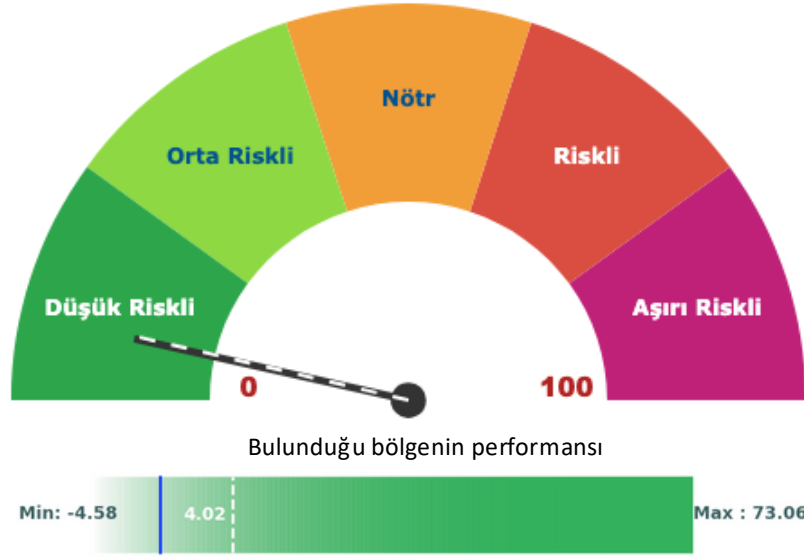


## BIST TEKNOLOJİ

BİST Teknoloji modeli bu hafta **düşük riskli** bölgede konumunu korumuştur.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda BİST Teknoloji Endeksi **yaklaşık %31 değer kazanmıştır**. BIST Teknoloji Endeksi getiri performansı düşük riskli bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında yer almaktadır**.

Bu hafta **7** Bir hafta önce **7** Bir ay önce **61**

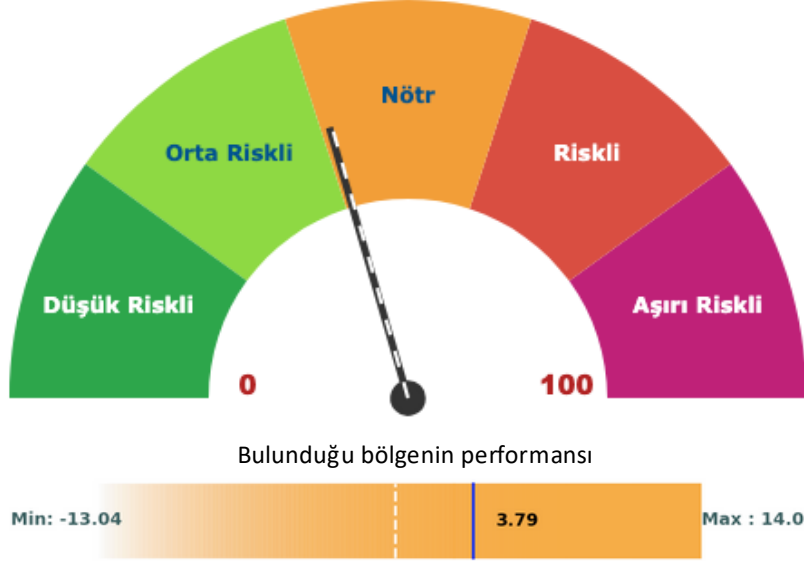


## BIST BANKACILIK

BIST Bankacılık modeli bu hafta **nötr bölgede** konumunu korumuştur.

BİST Bankacılık Endeksi, modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 aylık dönemde yaklaşık **%16.3 değer kazanmıştır**. Model nötr bölgeye girdiğinden beri endeksin performansı bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerindedir**.

Bu hafta **41** Bir hafta önce **41** Bir ay önce **45**

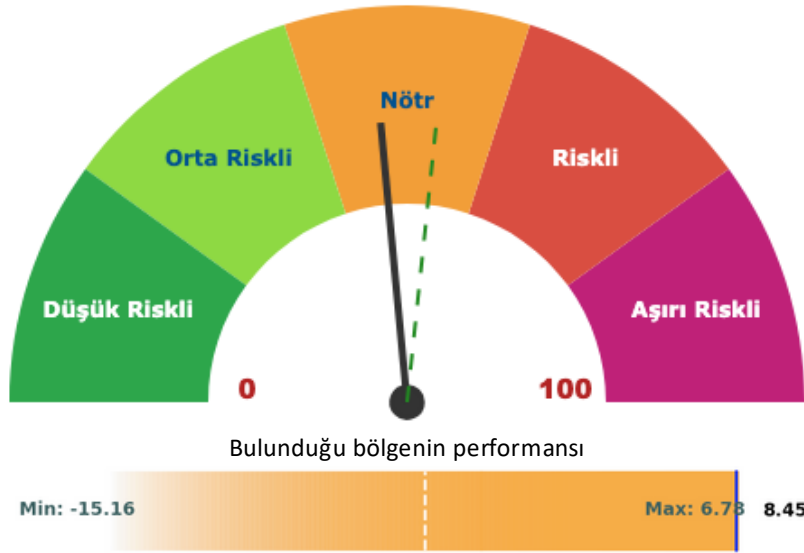


## BIST SINAI

**Nötr bölgede** bulunan BIST Sınai modeli 1 haftalık dönemde düşük riskli yöne ilerleyerek 1 ay önceki konumuna dönmüştür.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada endeks **yaklaşık %4 değer kazanmıştır**. Model nötr bölgeye girdiğinden beri BIST Sınai Endeksi performansı bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde yer almaktadır**.

Bu hafta **47** Bir hafta önce **53** Bir ay önce **47**

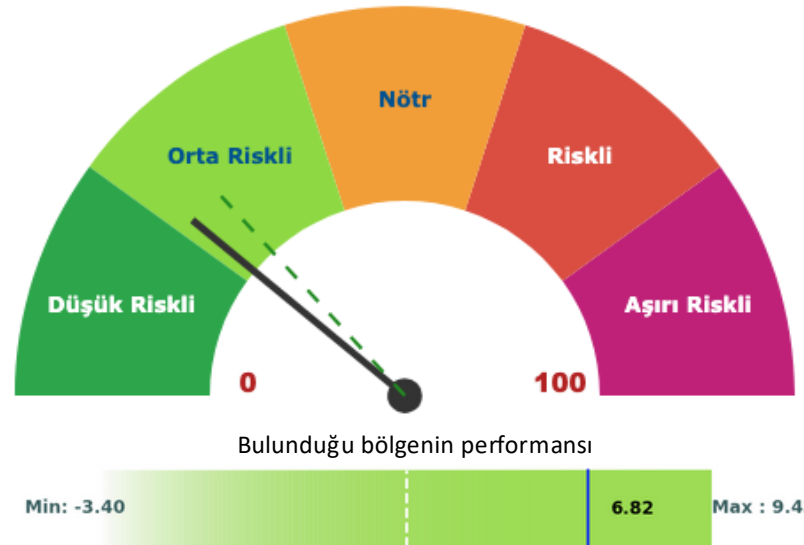


## ALTIN

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

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda Altın fiyatları **yaklaşık %2.75 değer kazanmıştır**. Model orta riskli bölgeye girdiğinden beri Altının getirisi bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üstünde yer almaktadır**.

Bu hafta **22** Bir hafta önce **26** Bir ay önce **26**



# RİSKOMETRE

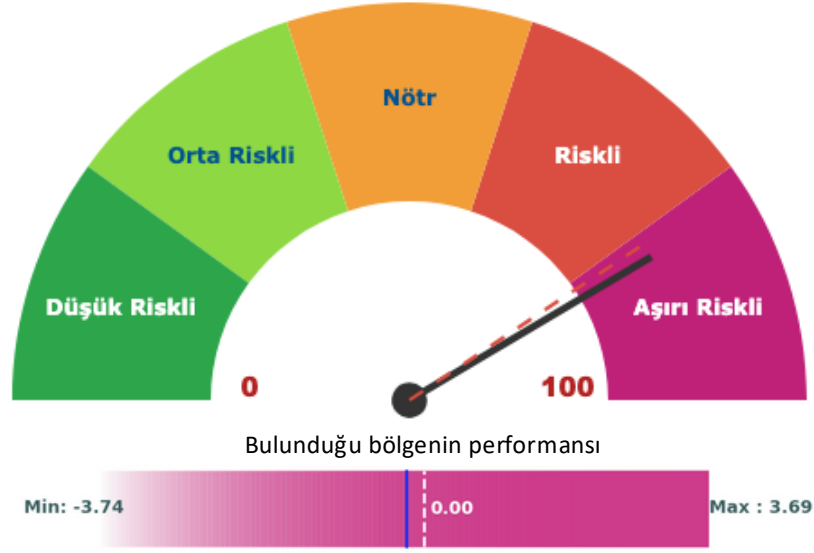
S&P

17 - 23 Mart 2025

ABD Hisse Senedi Modeli bu hafta **aşırı riskli** bölgede aşırı riskli yönde ilerlemiştir.

Modelin aşırı riskli yöne ilerlediği 1 ayda endeks yaklaşık **%8.8 değer kaybetmiştir**. Endeksin getiri performansı aşırı riskli bölgeye girdiğinden beri bu bölgedeki **ortalamasının altındadır**.

Bu hafta **83** Bir hafta önce **81** Bir ay önce **32**

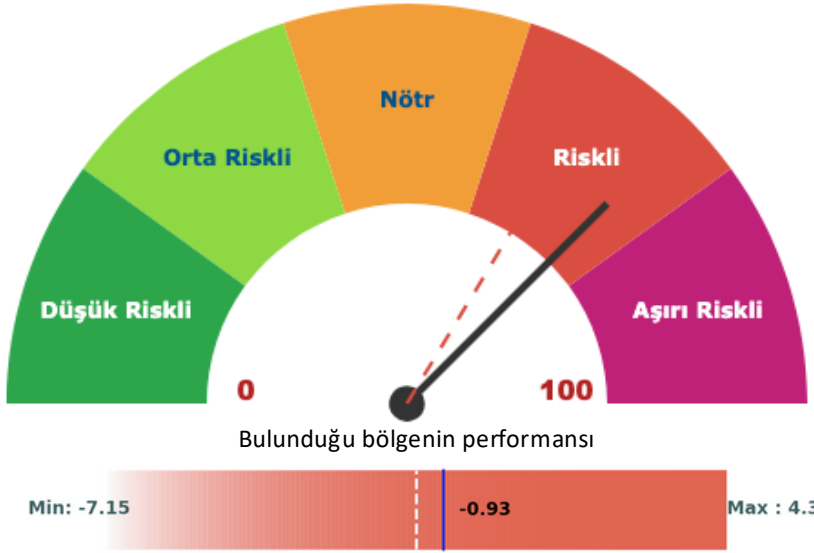


## NASDAQ

Nasdaq Modeli bu hafta **riskli bölgede** aşırı riskli yönde ilerlemiştir.

Modelin aşırı riskli yöne ilerlediği 1 ayda endeks yaklaşık **%12 değer kaybetmiştir**. Model riskli bölgeye girdiğinden beri endeksin getirisi bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde yer almaktadır**.

Bu hafta **75** Bir hafta önce **67** Bir ay önce **21**

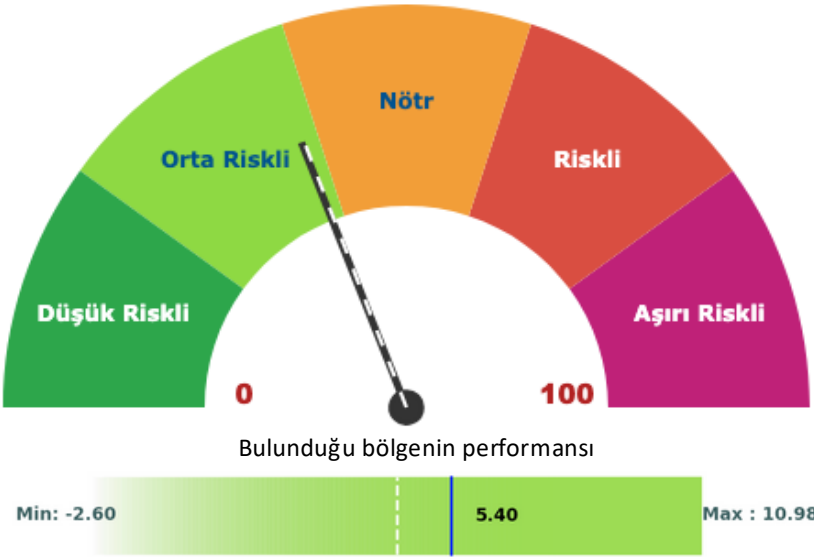


## DAX

1 aylık dönemde riskli yöne ilerleyen Almanya Hisse Senedi Modeli bu hafta **orta riskli** bölgede konumunu korumuştur.

Modelin sabit kaldığı 1 haftada DAX Endeksi **getirisi de stabil kalmıştır**. Model orta riskli bölgeye girdiğinden beri endeksin getiri performansı bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerindedir**.

Bu hafta **38** Bir hafta önce **38** Bir ay önce **35**

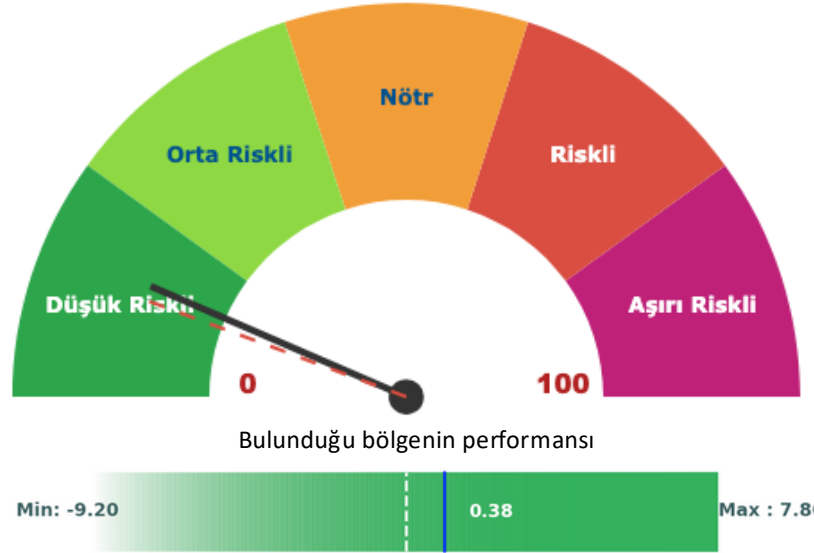


## NIKKEI

1 aylık dönemde düşük riskli yöne ilerleyen Japonya Hisse Senedi Modeli **düşük riskli bölgede** bulunmaktadır.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda Nikkei Endeksi **yaklaşık %1.8 değer kazanmıştır**. Endeksin getirisi düşük riskli bölgeye girdiğinden beri bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üstünde bulunmaktadır**.

Bu hafta **13** Bir hafta önce **11** Bir ay önce **32**



## PETROL

**Orta riskli** bölgede bulunan Petrol modeli 1 aylık dönemde riskli yönde hareket etmiştir.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 ayda petrol fiyatları **yaklaşık %6.7 değer kaybetmiştir**. Model orta riskli bölgeye girdiğinden beri petrolün getirisi bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında yer almaktadır**.

Bu hafta **38** Bir hafta önce **47** Bir ay önce **25**



# RİSKOMETRE

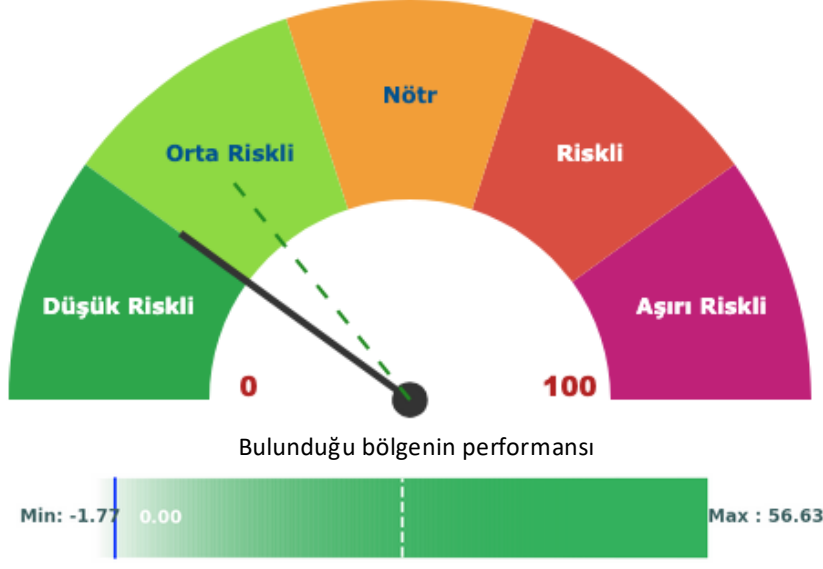
## GÜMÜŞ

17 - 23 Mart 2025

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

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda Gümüş fiyatları yaklaşık **%5.1 artmıştır**. Gümüşün getiri performansı düşük riskli bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında bulunmaktadır**.

Bu hafta **20** Bir hafta önce **28** Bir ay önce **30**

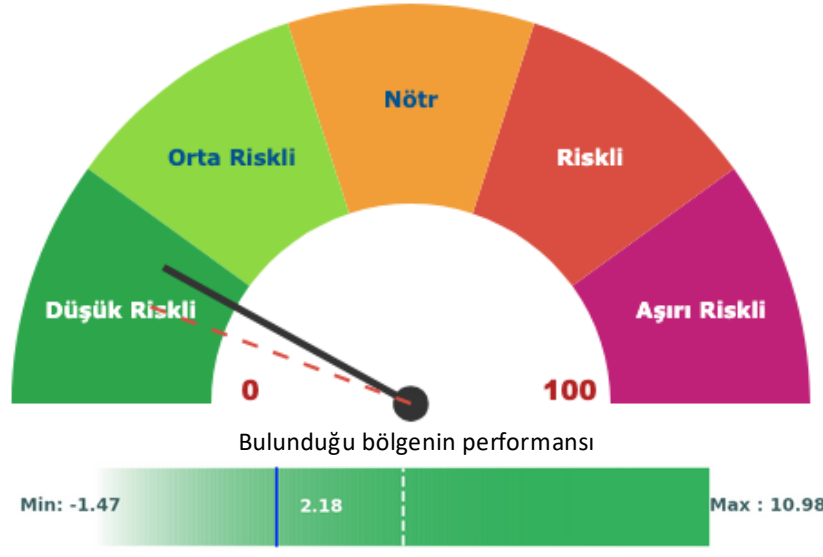


## GBPUSD

1 aylık dönemde düşük riskli yöne ilerleyen GBPUSD modeli bu hafta **düşük riskli** bölgededir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda parite yaklaşık **%4.1 değer kazanmıştır**. GBPUSD parite getirisi düşük riskli bölgeye girdiğinden beri bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında yer almaktadır**.

Bu hafta **16** Bir hafta önce **11** Bir ay önce **27**

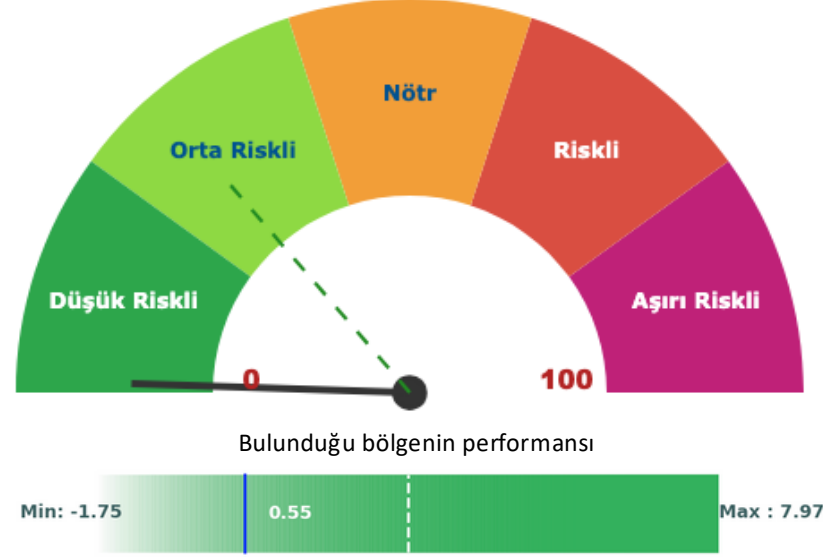


## EURUSD

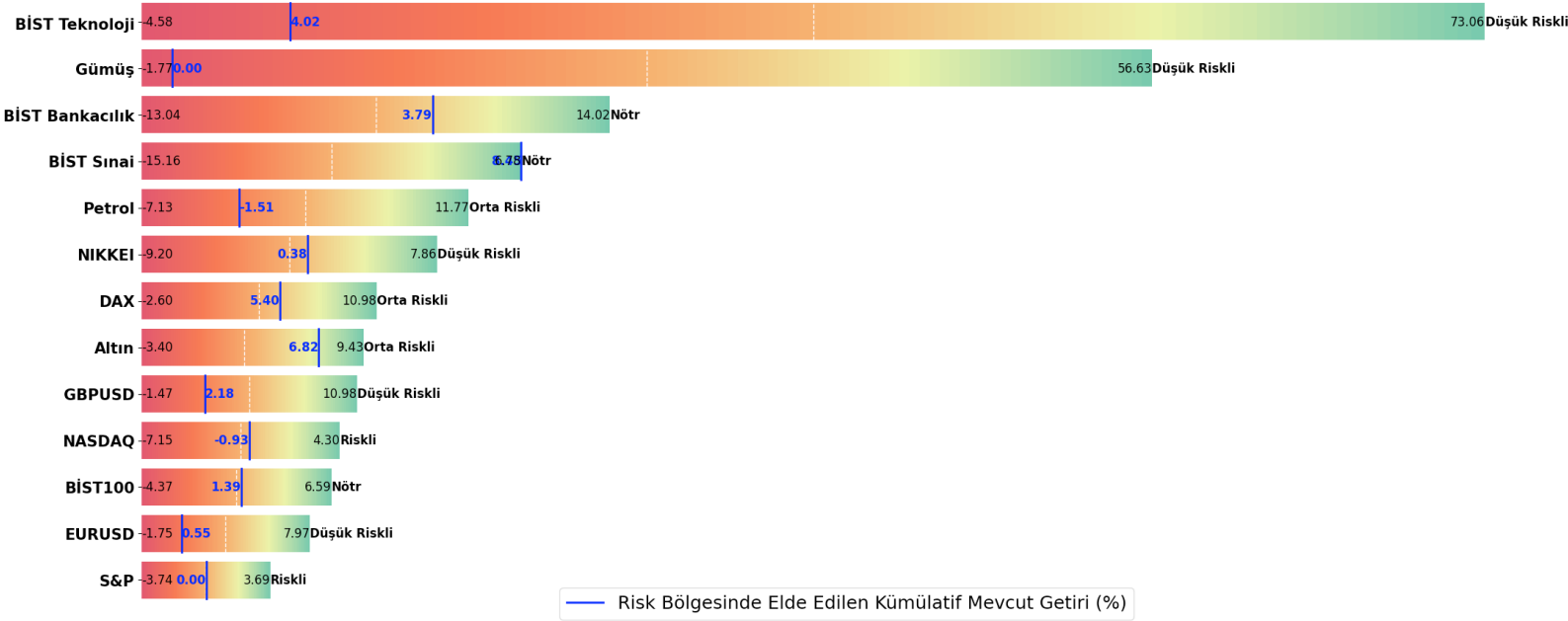
1 aylık dönemde düşük riskli yöne ilerleyen EURUSD modeli bu hafta **minimum** değerine ulaşmıştır.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda EURUSD paritesi **%4.5 değer kazanmıştır**. EURUSD parite performansı orta riskli bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında yer almaktadır**.

Bu hafta **1** Bir hafta önce **27** Bir ay önce **51**

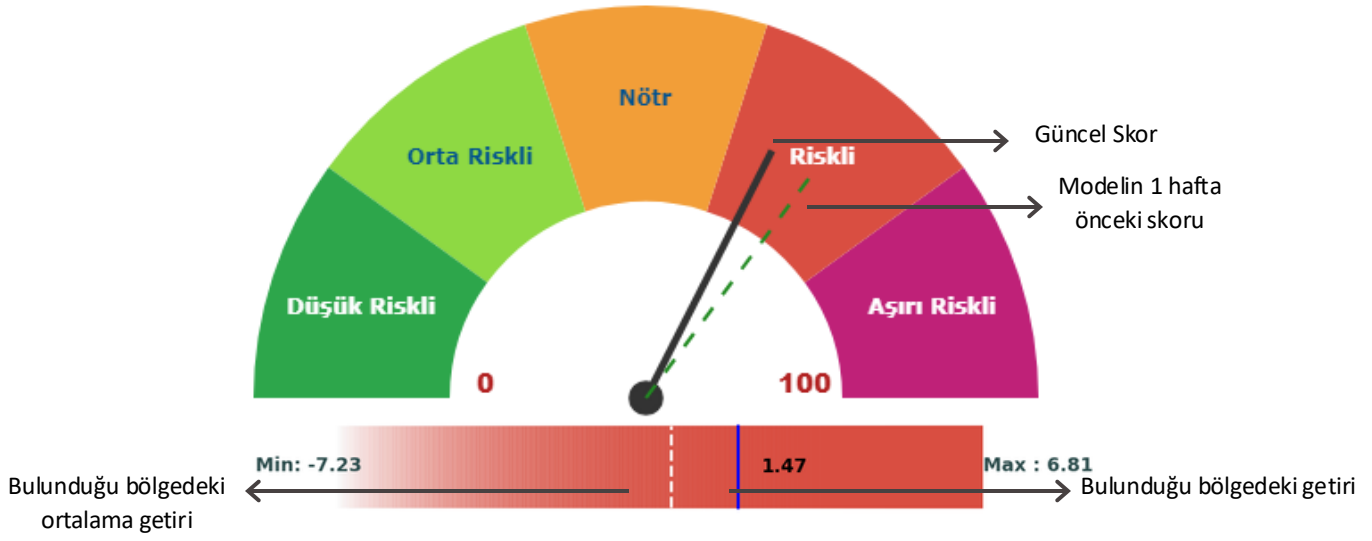


## Bulunduğu Bölgeye Göre Getiri Bantları



\*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:



## 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.”