

# RİSKOMETRE

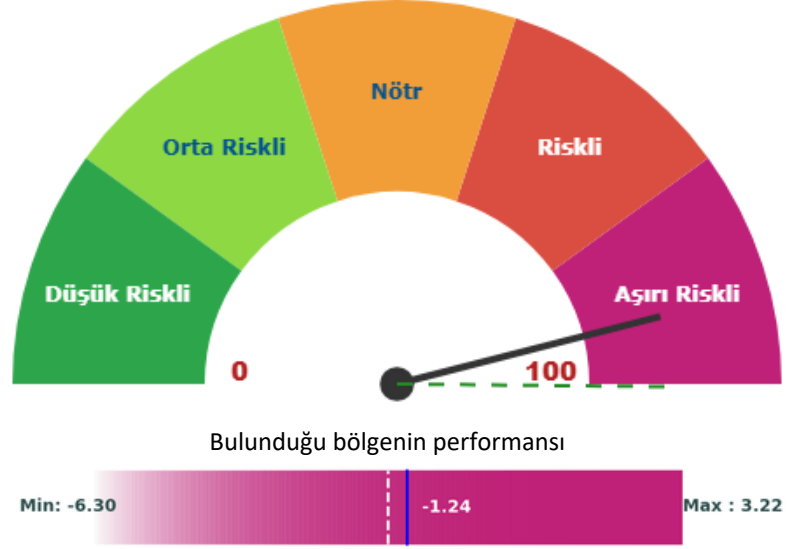
BİST100

31 Mart - 6 Nisan 2025

BİST100 modeli bu hafta **aşırı riskli** bölgede düşük riskli yöne ilerlemiştir

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftalık dönemde BİST100 Endeksi yaklaşık **%6.3 değer kazanmıştır**. Model aşırı riskli bölgeye girdiğinden beri BİST100 Endeksi performansı, bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır**.

Bu hafta **92** Bir hafta önce **100** Bir ay önce **70**

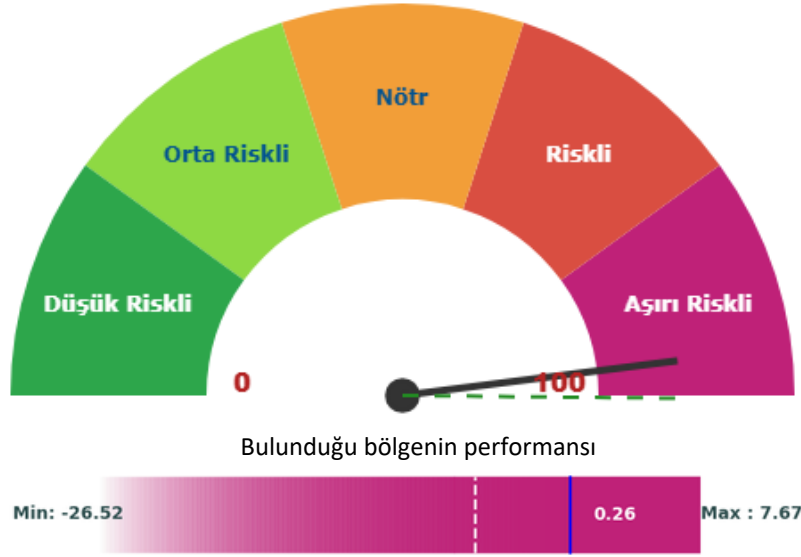


## BİST TEKNOLOJİ

BİST Teknoloji modeli **aşırı riskli** bölgede bulunmaya devam etmektedir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada BİST Teknoloji Endeksi **yaklaşık %7.4 değer kazanmıştır**. BİST Teknoloji Endeksi getiri performansı aşırı riskli bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde yer almaktadır**.

Bu hafta **96** Bir hafta önce **100** Bir ay önce **45**

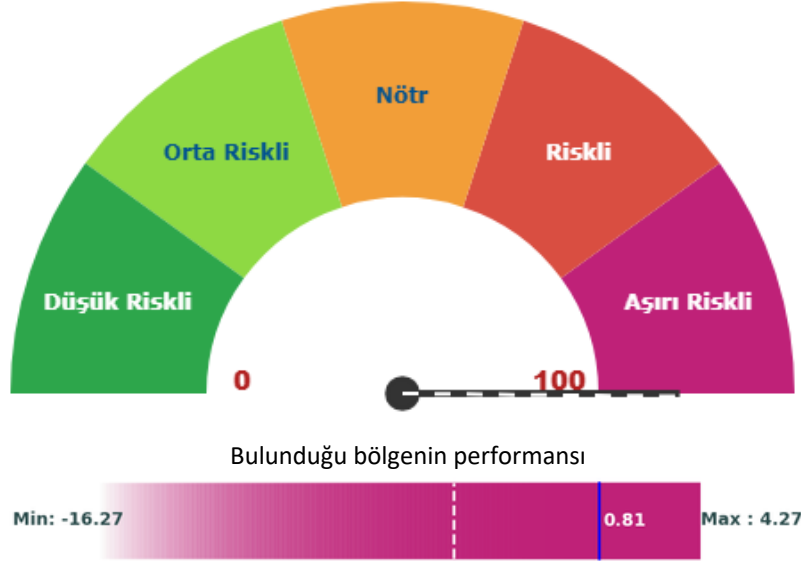


## BİST BANKACILIK

BİST Bankacılık modeli geçen hafta geçiş yaptığı **aşırı riskli bölgedeki maksimum değerini korumaktadır**.

BİST Bankacılık Endeksi, modelin aşırı riskli yöne ilerlediği 1 aylık dönemde **%14.9 değer kaybetmiştir**. Model bu bölgeye girdiğinden beri endeksin performansı bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır**.

Bu hafta **100** Bir hafta önce **100** Bir ay önce **50**

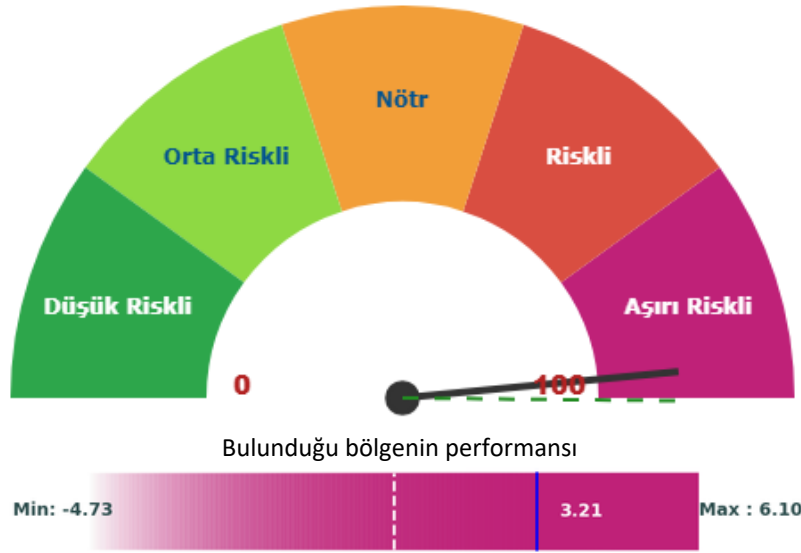


## BİST SINAI

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

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada endeks **yaklaşık %5.3 değer kazanmıştır**. Model bu bölgeye girdiğinden beri BİST Sınai Endeksi performansı bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde yer almaktadır**.

Bu hafta **97** Bir hafta önce **100** Bir ay önce **55**

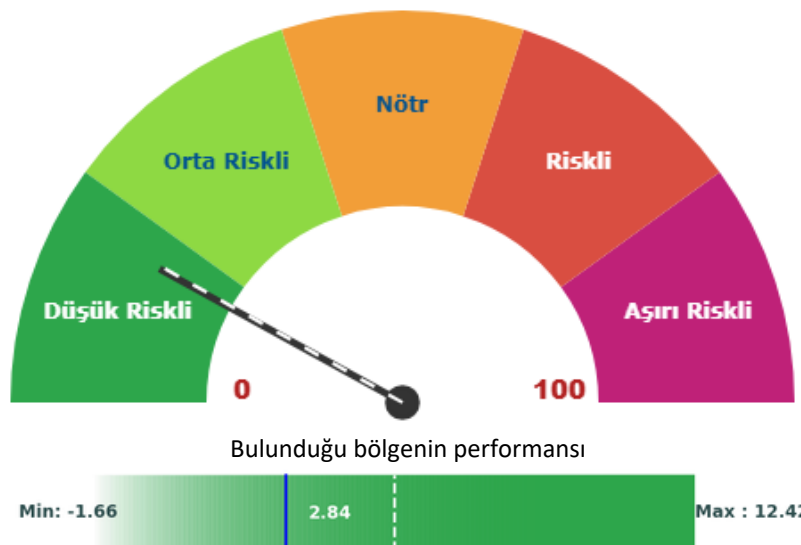


## ALTIN

Altın modeli bu hafta **düşük riskli** bölgedeki konumunu korumaktadır.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda Altın fiyatları **yaklaşık %5.7 değer kazanmıştır**. Model düşük riskli bölgeye girdiğinden beri Altının getirisi bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında yer almaktadır**.

Bu hafta **16** Bir hafta önce **16** Bir ay önce **29**



# RİSKOMETRE

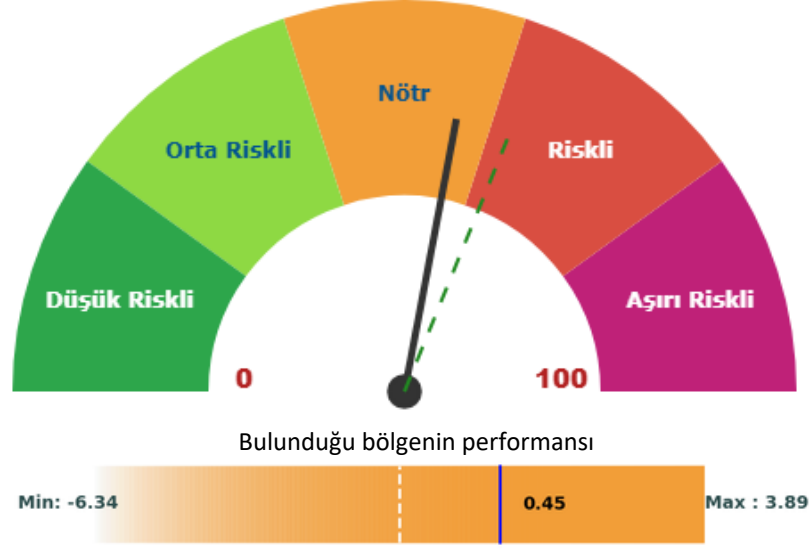
S&P

31 Mart - 6 Nisan 2025

ABD Hisse Senedi Modeli bu hafta riskli bölgeden **nötr bölgeye** geçiş yapmıştır.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada endeks yaklaşık **%0.5 değer kazanmıştır**. Endeksin getiri performansı nötr bölgeye girdiğinden beri bu bölgedeki **ortalamasının üzerindedir**.

Bu hafta **56** Bir hafta önce **62** Bir ay önce **53**

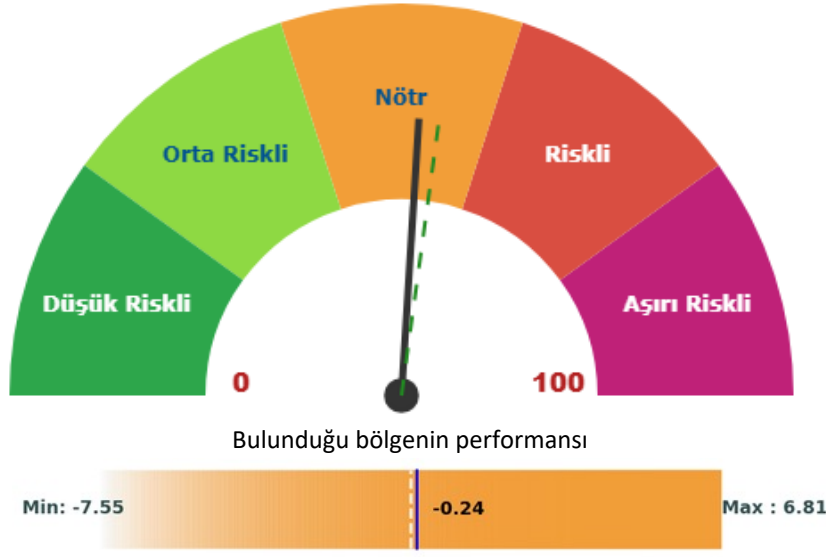


## NASDAQ

Nasdaq Modeli bu hafta **nötr bölgede** düşük riskli yönde ilerlemiştir.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 ayda endeks yaklaşık **%6.5 değer kaybetmiştir**. Model nötr bölgeye girdiğinden beri endeksin getirisi bu bölgedeki **tarihsel ortalamasına yakındır**.

Bu hafta **52** Bir hafta önce **54** Bir ay önce **46**

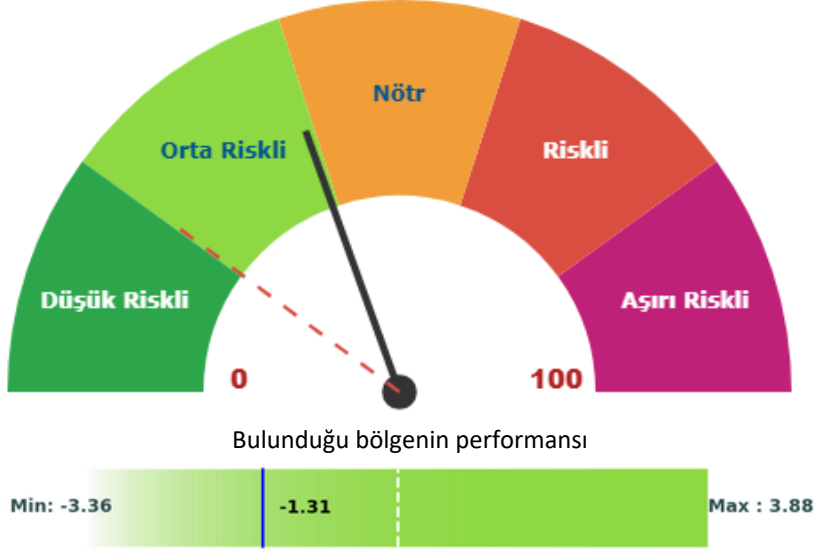


## DAX

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

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

Bu hafta **39** Bir hafta önce **20** Bir ay önce **1**

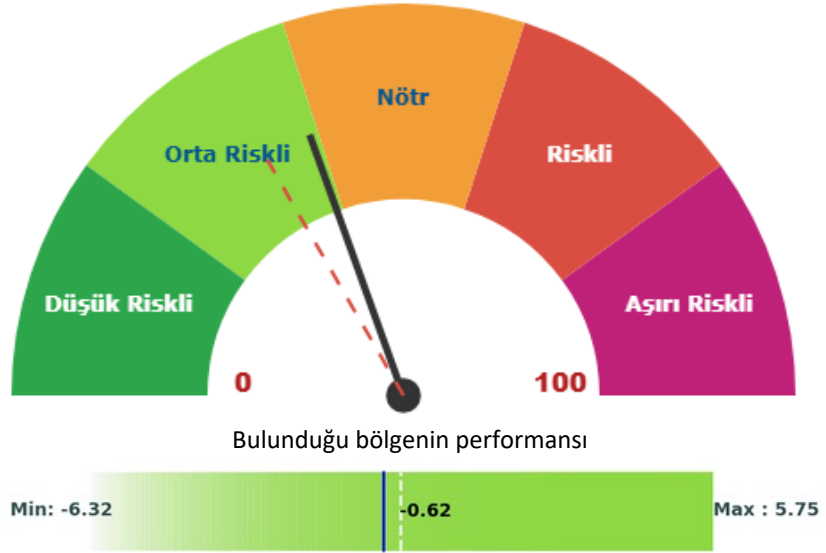


## NIKKEI

Japonya Hisse Senedi modeli **orta riskli bölgede** riskli yönde ilerlemiştir.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftada Nikkei Endeksi **yaklaşık %1 değer kaybetmiştir**. Endeksin getirisi orta riskli bölgeye girdiğinden beri bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında bulunmaktadır**.

Bu hafta **39** Bir hafta önce **33** Bir ay önce **19**



## PETROL

Petrol modeli 1 aylık dönemde **orta riskli bölge** içinde düşük riskli yönde ilerlemiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada petrol fiyatları **yaklaşık %2.6 değer kazanmıştır**. Model orta riskli bölgeye girdiğinden beri petrolün getirisi bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında yer almaktadır**.

Bu hafta **21** Bir hafta önce **22** Bir ay önce **32**



# RİSKOMETRE

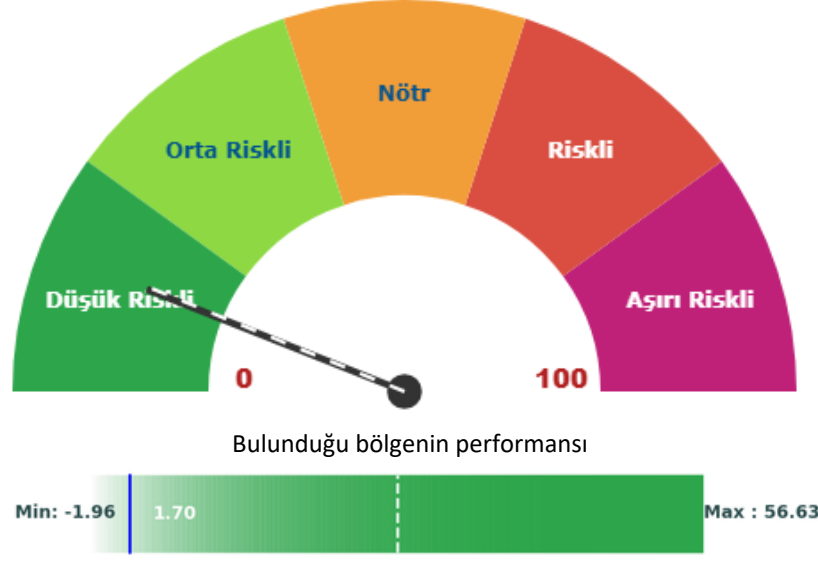
## GÜMÜŞ

31 Mart - 6 Nisan 2025

Gümüş modeli 1 aylık dönemde **düşük riskli** yönde ilerlemiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda Gümüş fiyatları yaklaşık **%8 artmıştır**. Gümüşün getiri performansı düşük riskli bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında** bulunmaktadır.

Bu hafta **12** Bir hafta önce **12** Bir ay önce **38**

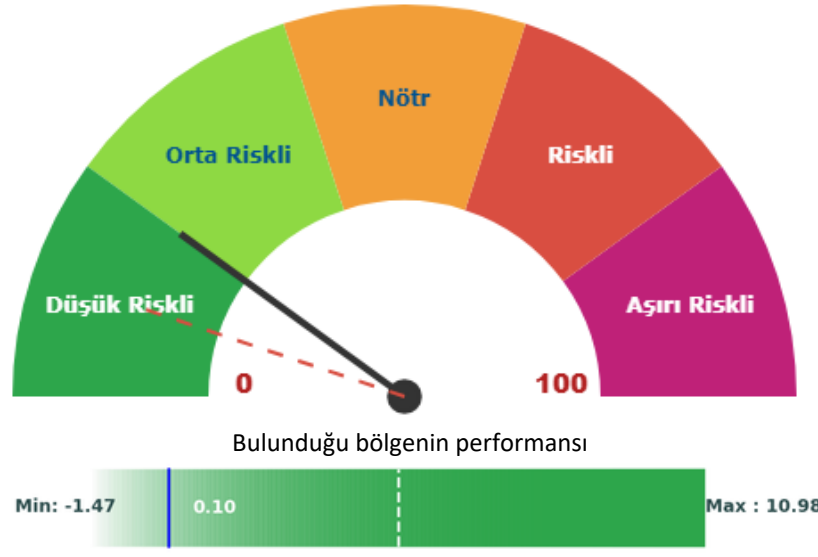


## GBPUSD

GBPUSD modeli 1 aylık dönemde **düşük riskli** bölgede bulunmaktadır.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda parite yaklaşık **%3 değer kazanmıştır**. GBPUSD parite getirisi düşük riskli bölgeye girdiğinden beri bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında** yer almaktadır.

Bu hafta **20** Bir hafta önce **10** Bir ay önce **21**

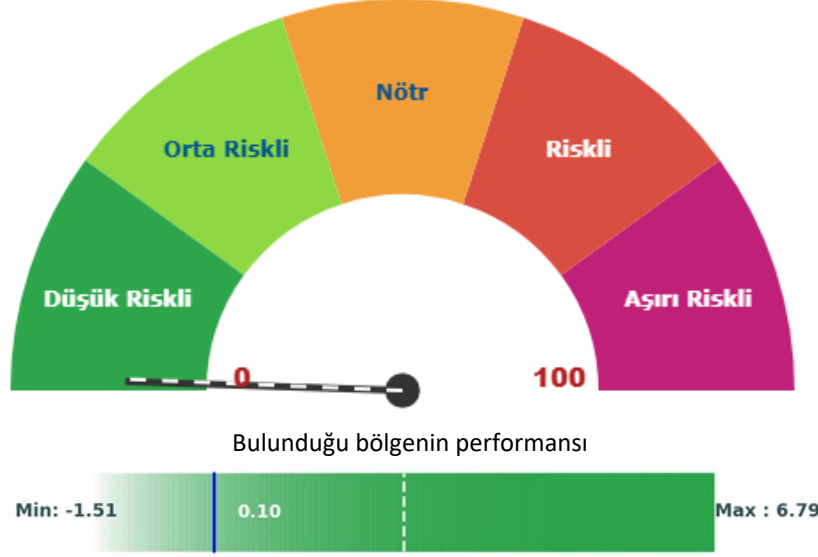


## EURUSD

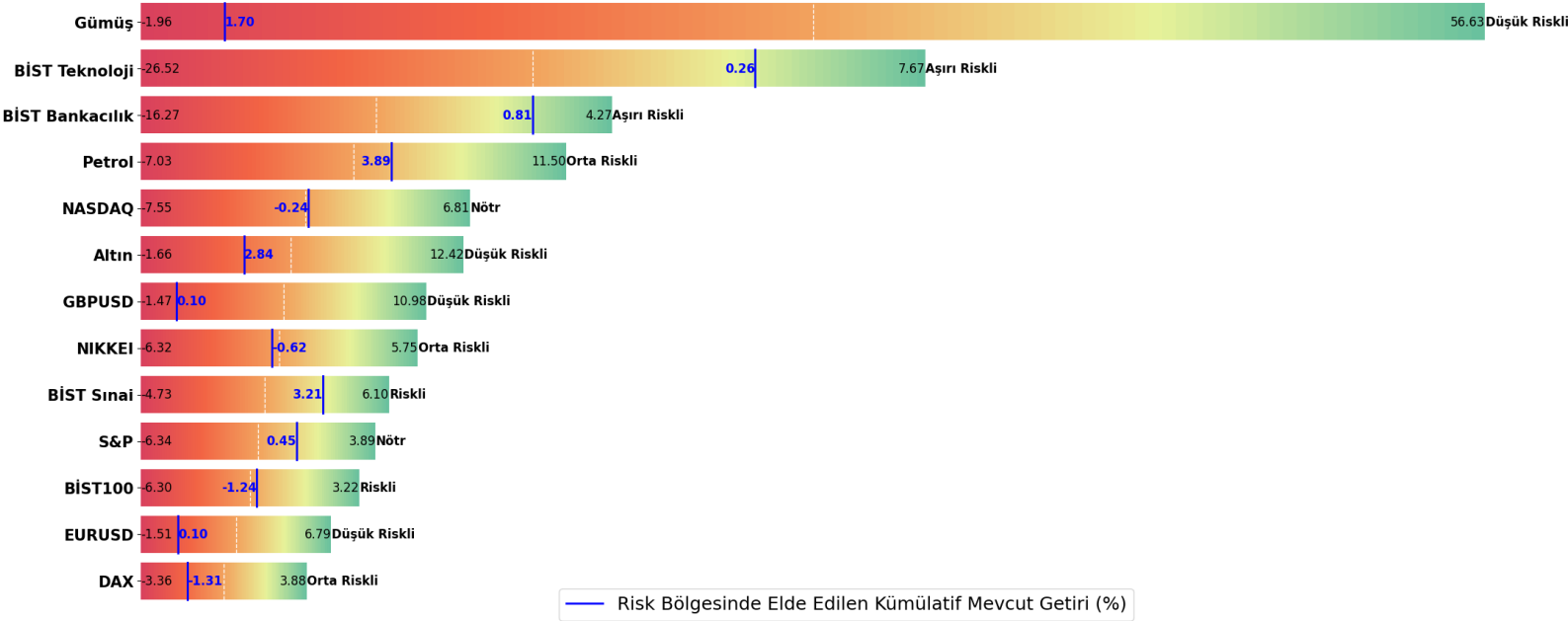
1 aylık dönemde düşük riskli yöne ilerleyen EURUSD modeli bu hafta da **düşük riskli** bölgede **minimum** değerindedir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda EURUSD paritesi **%4.3 değer kazanmıştır**. EURUSD parite performansı düşük riskli bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında** yer almaktadır.

Bu hafta **1** Bir hafta önce **1** Bir ay önce **32**

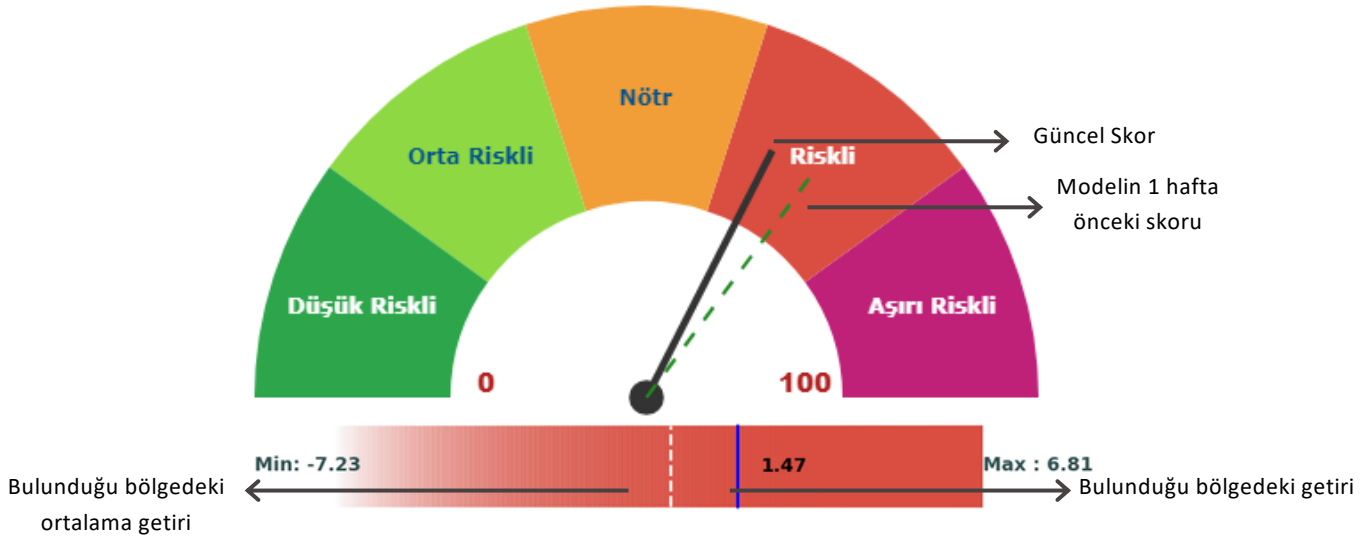


## Bulunduğu Bölgeye Göre Getiri Bantları



\*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](http://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."