

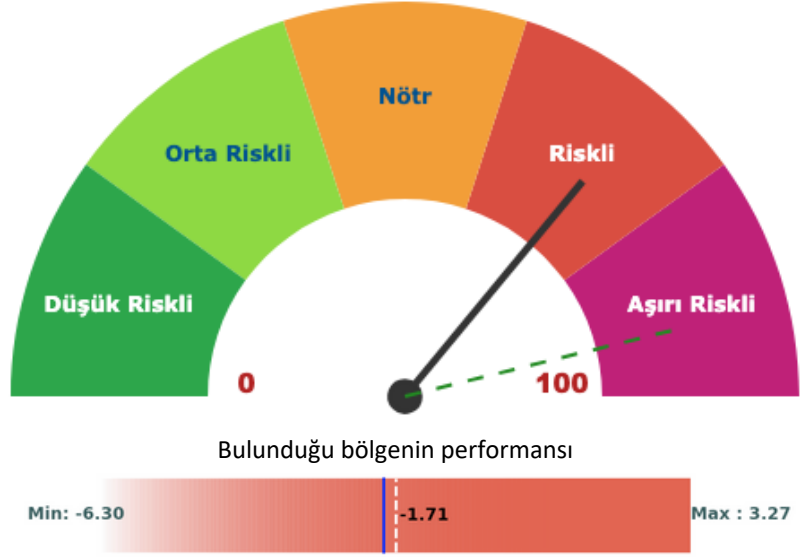
RİSKOMETRE

BIST100

7 - 13 Nisan 2025

BIST100 modeli bu hafta düşük riskli yöne ilerleyerek aşırı riskli bölgeden **riskli bölgeye** geçiş yapmıştır.

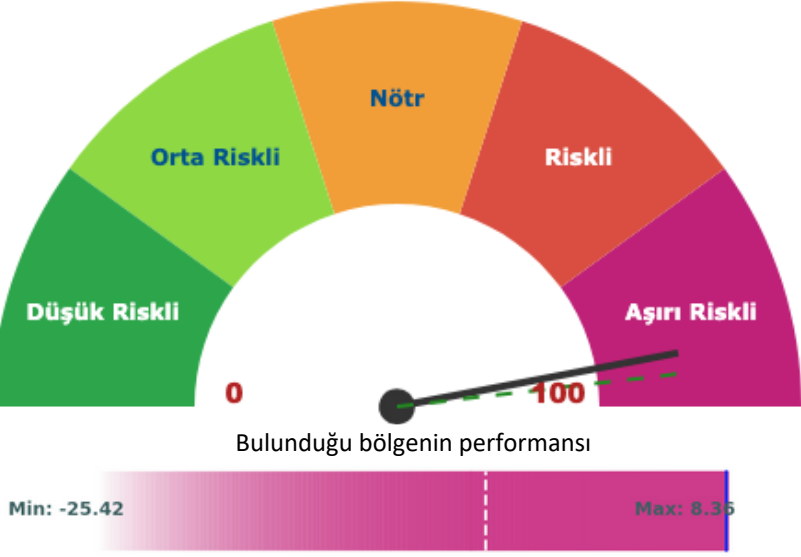
Modelin aşırı riskli yöne ilerlediği 1 aylık dönemde BIST100 Endeksi yaklaşık **%9.6 değer kaybetmiştir**. Model riskli bölgeye girdiğinden beri BIST100 Endeksi performansı, bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında bulunmaktadır**.



BIST TEKNOLOJİ

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

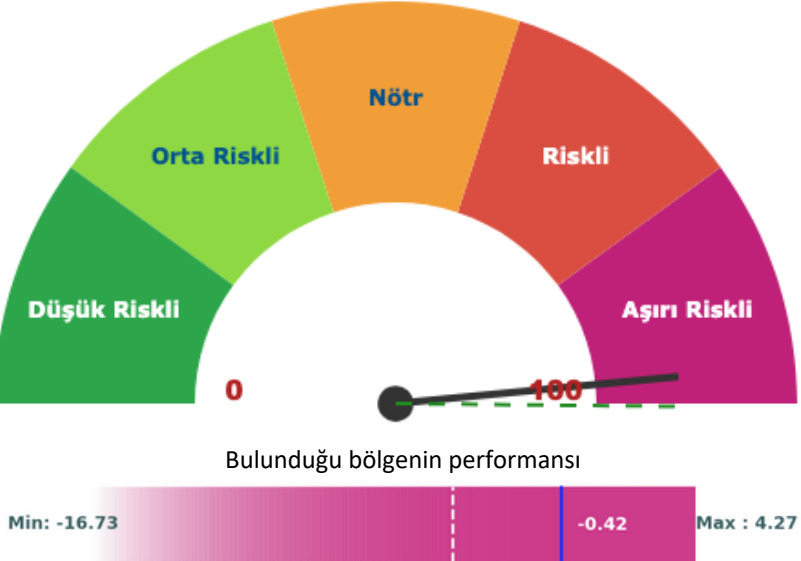
Modelin aşırı riskli sinyali verdiği 1 haftada BİST Teknoloji Endeksi **yaklaşık %1 değer kaybetmiştir**. BIST Teknoloji Endeksi getiri performansı aşırı riskli bölgedeki **tarihsel maksimum değeri yakınlarındadır**.



BIST BANKACILIK

BIST Bankacılık modeli bu hafta **aşırı riskli bölgede** bulunmaya devam etmektedir.

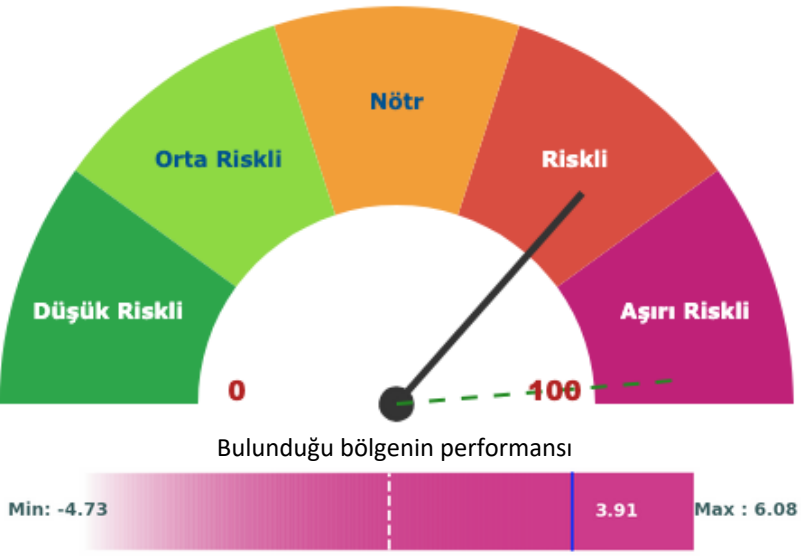
BİST Bankacılık Endeksi, modelin aşırı riskli yöne ilerlediği 1 aylık dönemde **%24 değer kaybetmiştir**. Model bu bölgeye girdiğinden beri endeksin performansı bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır**.



BIST SİNAİ

BIST Sınai modeli bu hafta aşırı riskli bölgeden **riskli bölgeye** geçiş yapmıştır.

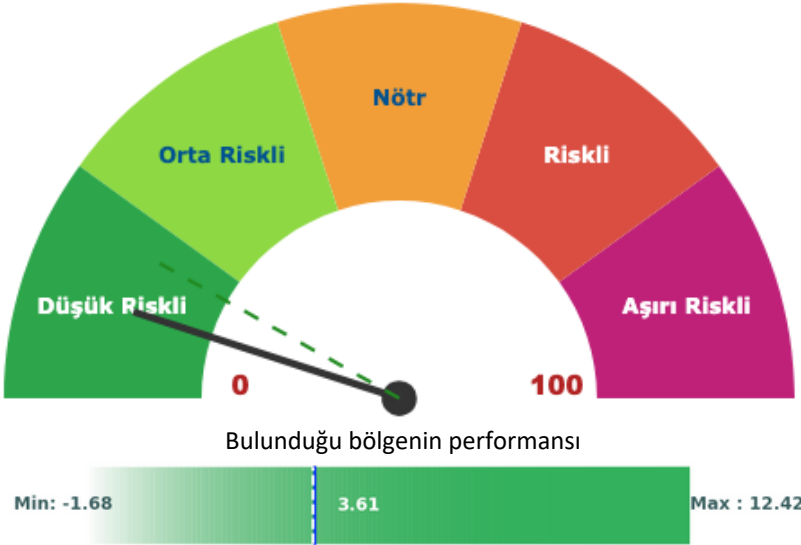
Modelin riskli yönde ilerlediği 1 ayda endeks **yaklaşık %3.3 değer kaybetmiştir**. Model riskli bölgeye girdiğinden beri BIST Sınai Endeksi performansı bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde yer almaktadır**.



ALTIN

Altın modeli bu hafta **düşük riskli bölgede** düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda Altın fiyatları **yaklaşık %6.1 değer kazanmıştır**. Model düşük riskli bölgeye girdiğinden beri Altının getirisi bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının yakınında yer almaktadır**.



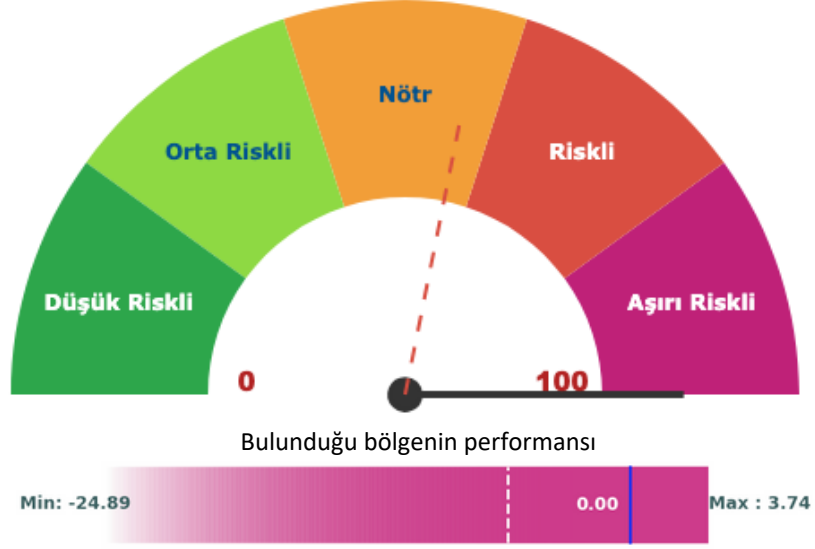
RİSKOMETRE

S&P

7 - 13 Nisan 2025

1 aylık dönemde dalgalı seyreden ABD Hisse Senedi Modeli bu hafta nötr bölgeden **aşırı riskli bölgeye** geçerek maksimum değerine ulaşmıştır.

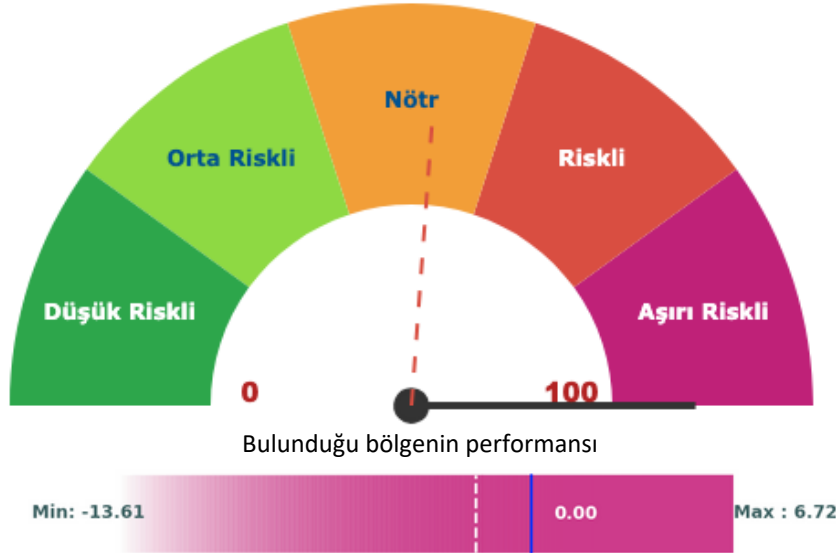
Modelin aşırı riskli yöne ilerlediği 1 haftada endeks yaklaşık **%7.6** değer kaybetmiştir. Endeksin getiri performansı aşırı riskli bölgeye girdiğinden beri bu bölgedeki **ortalamasının üzerindedir.**



NASDAQ

Nasdaq Modeli 1 aylık dalgalanmanın ardından bu hafta nötr bölgeden **aşırı riskli bölgeye** geçerek maksimum değerine gelmiştir.

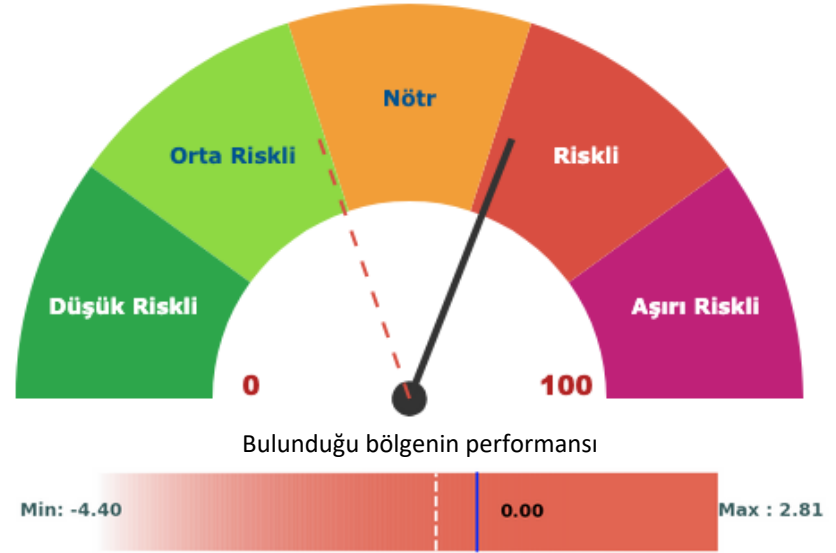
Modelin aşırı riskli yöne ilerlediği 1 ayda endeks yaklaşık **%10.8** değer kaybetmiştir. Model bu bölgeye girdiğinden beri endeksin getirisi aşırı riskli bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerindedir.**



DAX

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

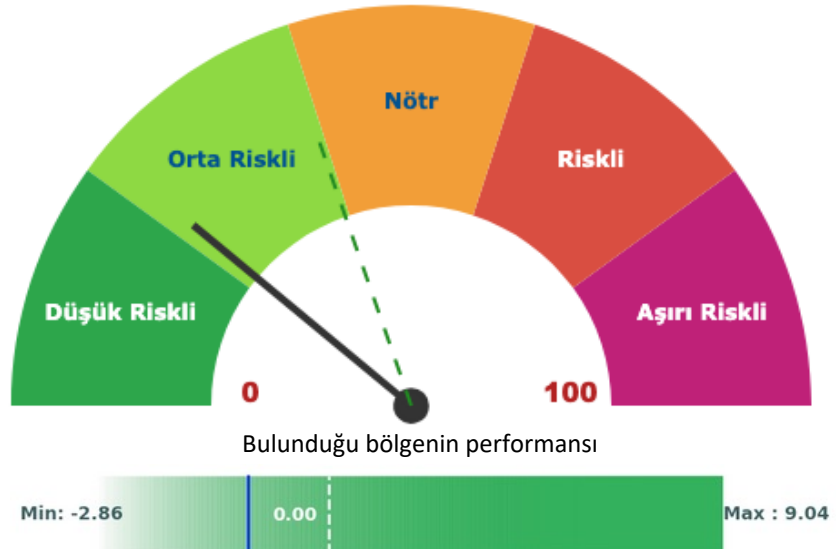
Modelin aşırı riskli yöne ilerlediği 1 ayda DAX Endeksi yaklaşık **%6.8** değer kaybetmiştir. Model riskli bölgeye girdiğinden beri endeksin getiri performansı bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerindedir.**



NIKKEI

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

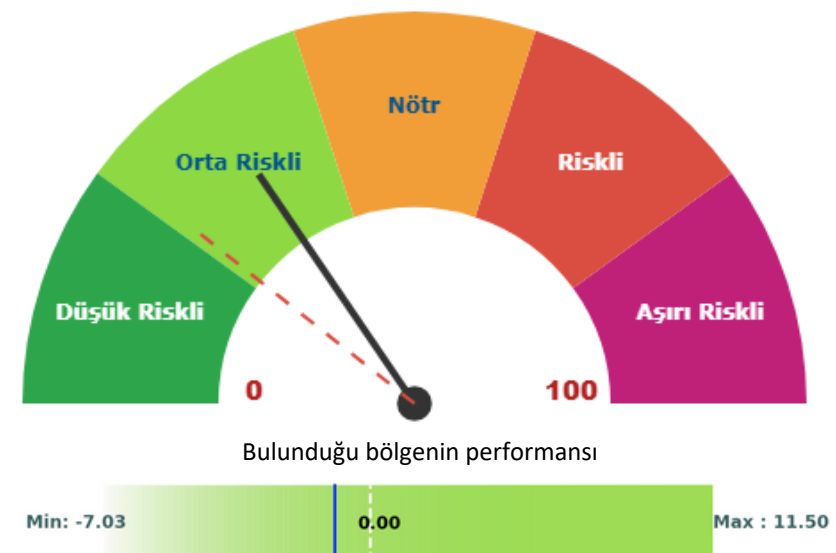
Modelin riskli yöne ilerlediği 1 ayda Nikkei Endeksi **yaklaşık %6.8** değer kaybetmiştir. Endeksin getirisi orta riskli bölgeye girdiğinden beri bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında bulunmaktadır.**



PETROL

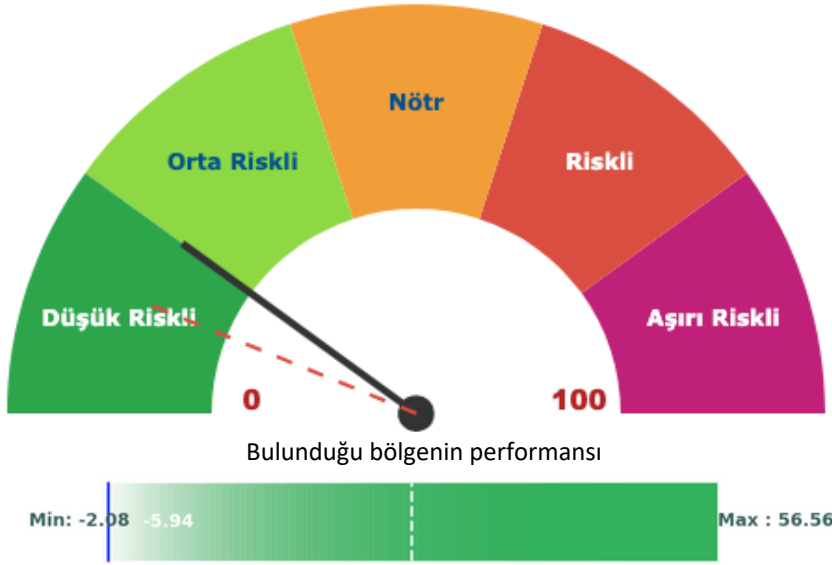
1 aylık dönemde düşük riskli yöne ilerleyen Petrol modeli bu hafta **orta riskli** bölge içinde riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftada petrol fiyatları **yaklaşık %8** değer kaybetmiştir. Model orta riskli bölgeye girdiğinden beri petrolün getirisi bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında yer almaktadır.**



Gümüş modeli bu hafta **düşük riskli** bölge içinde riskli yöne ilerlemiştir.

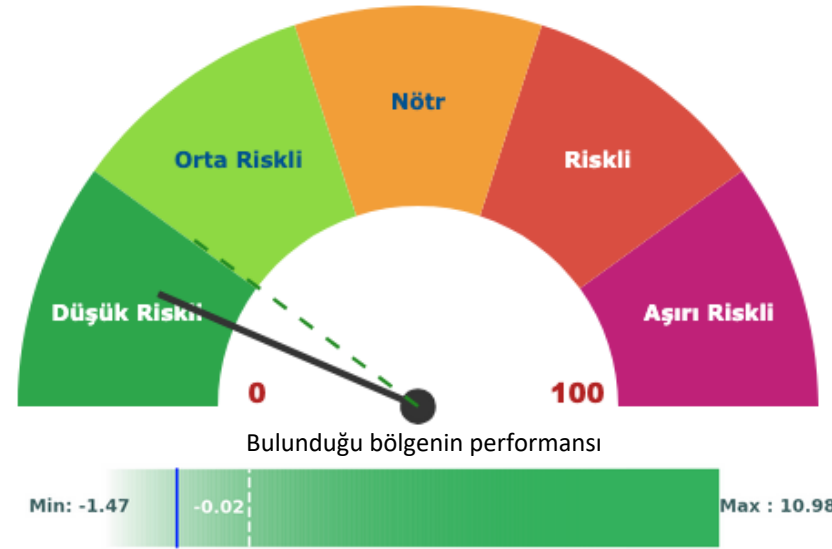
Modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftada Gümüş fiyatları yaklaşık **%8 değer kaybetmiştir**. Gümüşün getiri performansı düşük riskli bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında** bulunmaktadır.



GBPUSD

1 aylık dönemde **düşük riskli** bölgede bulunan GBPUSD modeli bu hafta düşük riskli yöne ilerlemiştir.

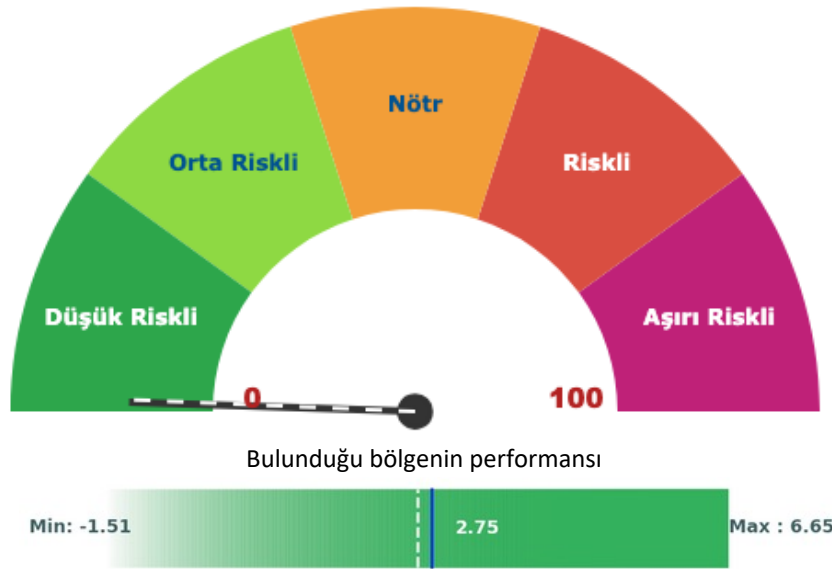
Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada parite yaklaşık **%0.5 değer kazanmıştır**. GBPUSD parite getirisi düşük riskli bölgeye girdiğinden beri bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında** yer almaktadır.



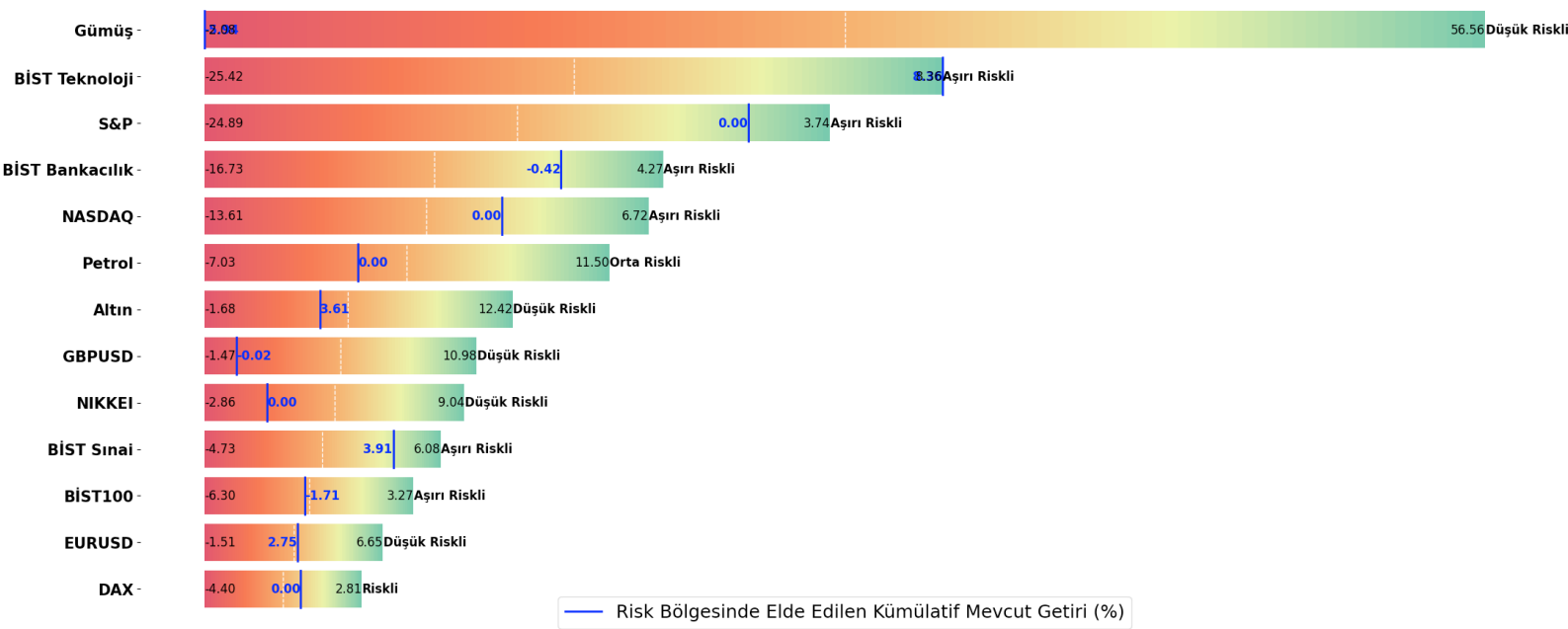
EURUSD

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

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda EURUSD paritesi **%1.5 değer kazanmıştır**. EURUSD parite performansı düşük riskli bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde** yer almaktadır.

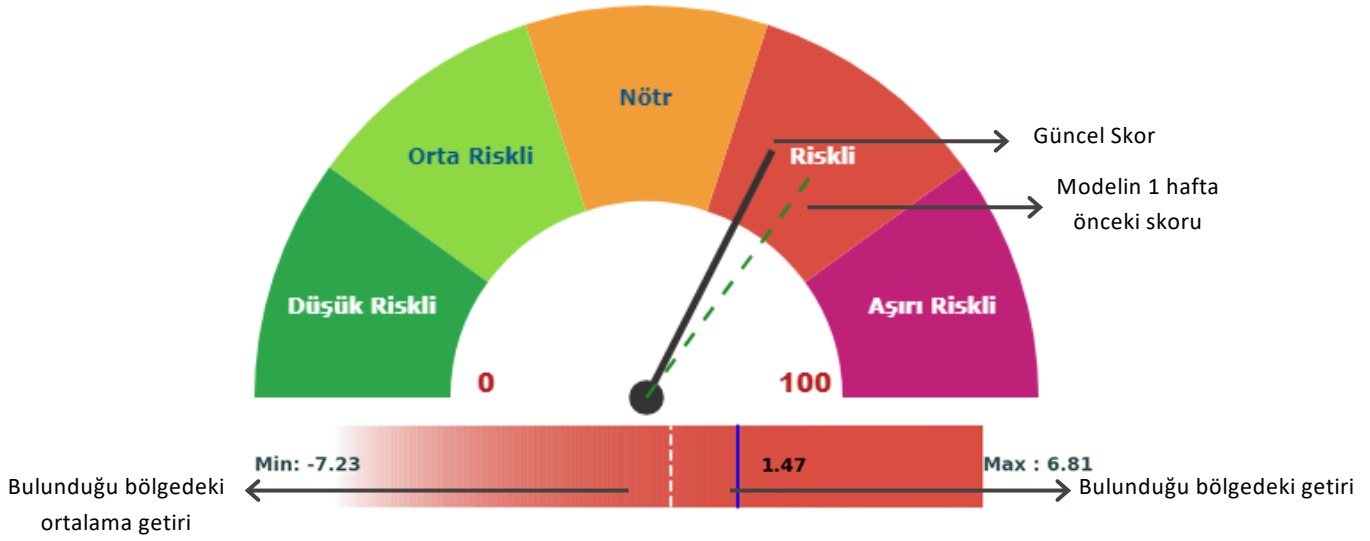


Bulunduğu Bölgeye Göre Getiri Bantları



*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.”