

RİSKOMETRE

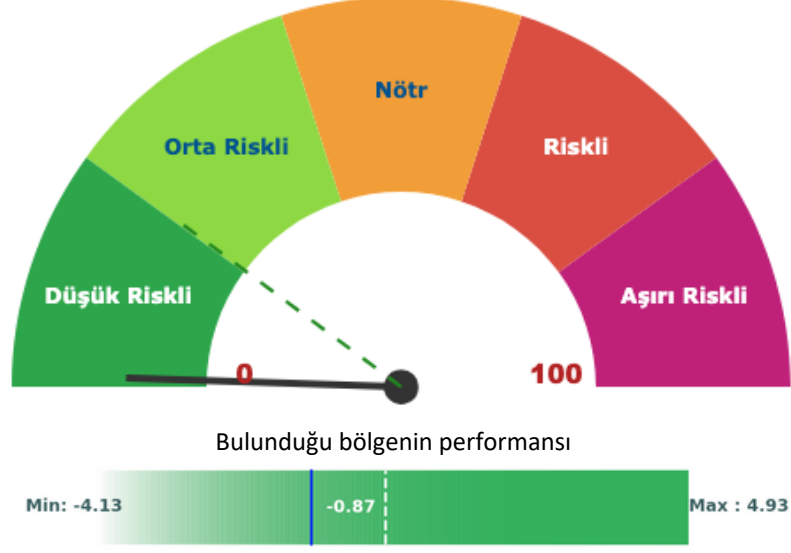
BİST100

19 - 25 Mayıs 2025

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

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 aylık dönemde BİST100 Endeksi yaklaşık **%3.1 değer kazanmıştır**. Model düşük riskli bölgeye girdiğinden beri BİST100 Endeksi performansı, bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında** bulunmaktadır.

Bu hafta **1** Bir hafta önce **20** Bir ay önce **65**

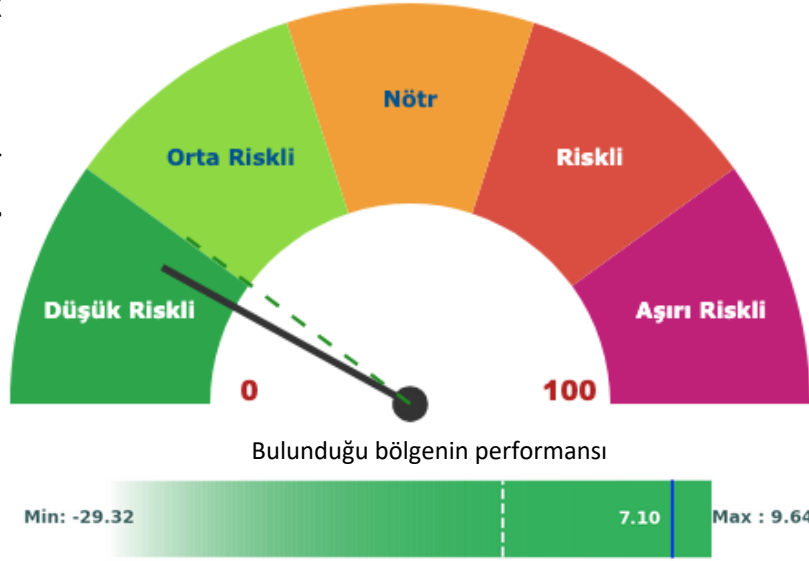


BİST TEKNOLOJİ

BİST Teknoloji Modeli 1 aylık dönemde **düşük riskli** yönde ilerlemiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda BİST Teknoloji Endeksi yaklaşık **%6.25 değer kazanmıştır**. BİST Teknoloji Endeksi getiri performansı bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde** bulunmaktadır.

Bu hafta **16** Bir hafta önce **20** Bir ay önce **86**

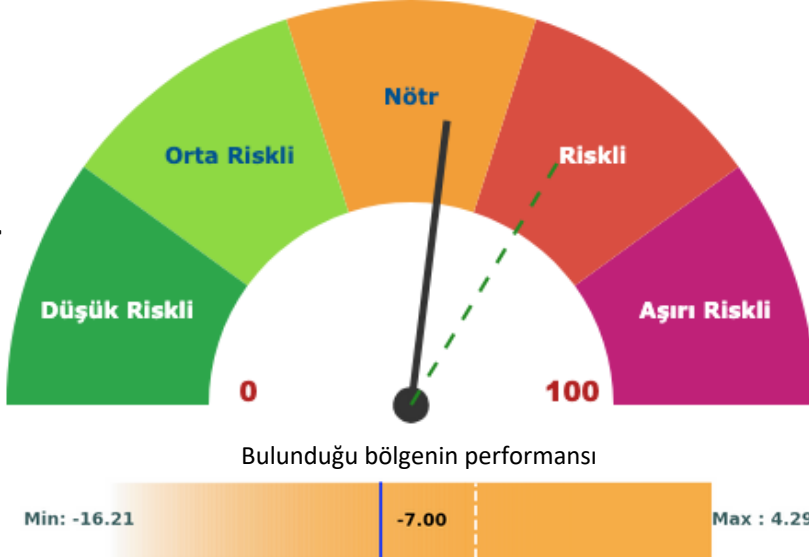


BİST BANKACILIK

BİST Bankacılık modeli bu hafta riskli bölgeden **nötr bölgeye** geçiş yapmıştır.

BİST Bankacılık Endeksi modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda yaklaşık **%6.3 değer kazanmıştır**. Model bu bölgeye girdiğinden beri endeksin performansı bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altındadır**.

Bu hafta **54** Bir hafta önce **67** Bir ay önce **97**

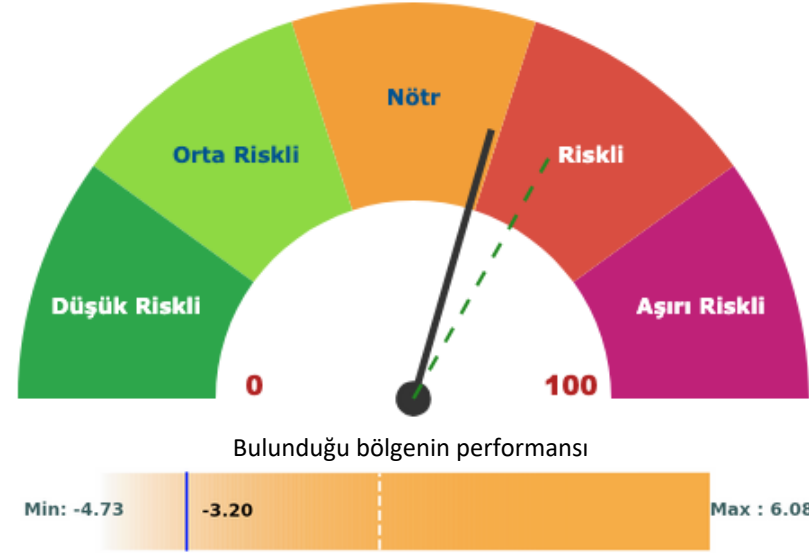


BİST SİNAİ

1 ayda düşük riskli yöne ilerleyen BİST Sınai modeli bu hafta **nötr bölgeye** geçiş yapmıştır.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda endeks yaklaşık **%2.8 değer kazanmıştır**. Model nötr bölgeye girdiğinden beri BİST Sınai Endeksi performansı bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında** yer almaktadır.

Bu hafta **59** Bir hafta önce **66** Bir ay önce **83**

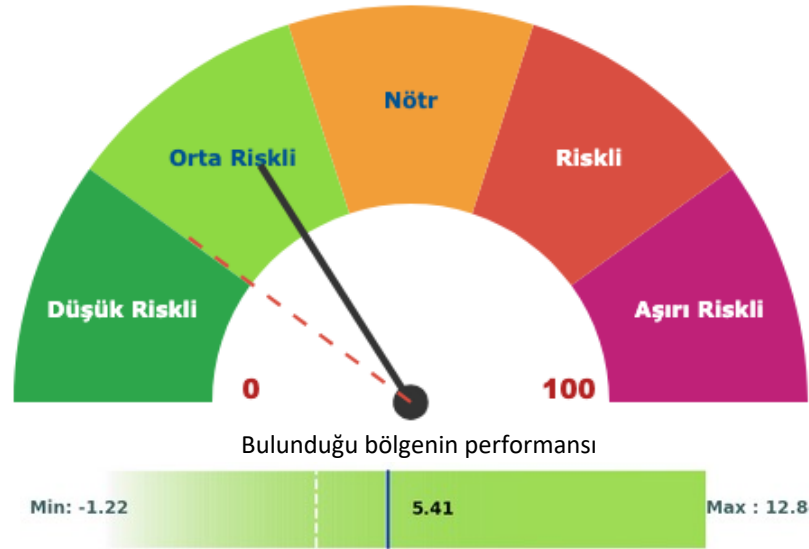


ALTIN

1 aylık dönemde riskli yönde ilerleyen Altın modeli bu hafta **orta riskli bölgeye** geçiş yapmıştır.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 ayda Altın fiyatları yaklaşık **%3.6 değer kaybetmiştir**. Model orta riskli bölgeye girdiğinden beri Altının getirisi bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üstünde** bulunmaktadır.

Bu hafta **32** Bir hafta önce **20** Bir ay önce **6**



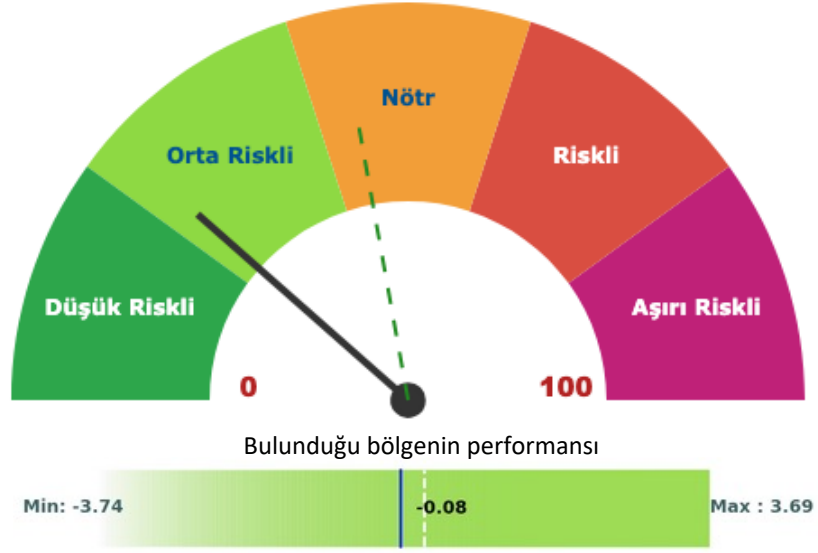
RİSKOMETRE

S&P

19 - 25 Mayıs 2025

Orta riskli bölgede bulunan ABD Hisse Senedi Modeli 1 aylık dönemde düşük riskli yöne ilerlemektedir.

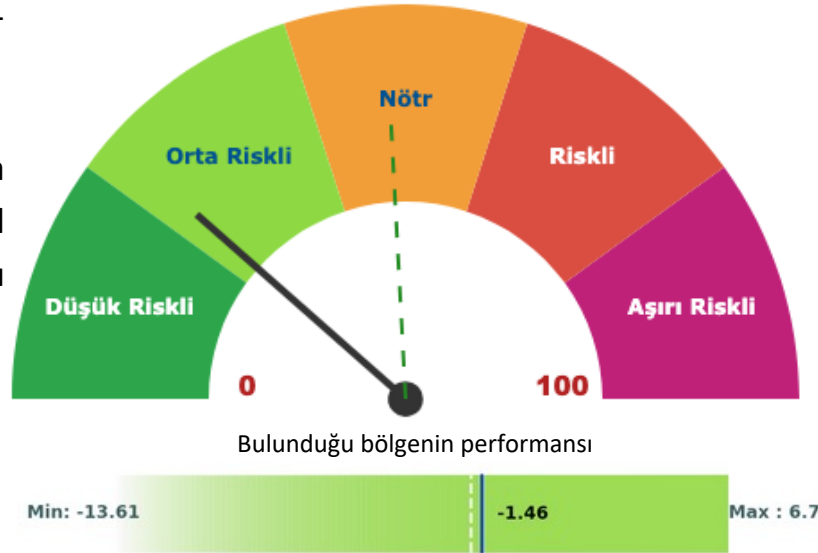
Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda endeks yaklaşık **%12 değer kazanmıştır**. Endeksin getiri performansı orta riskli bölgeye girdiğinden beri bu bölgedeki **ortalamasının altında bulunmaktadır**.



NASDAQ

Orta riskli bölgede bulunan Nasdaq Modeli 1 aylık dönemde düşük riskli yönde ilerlemektedir.

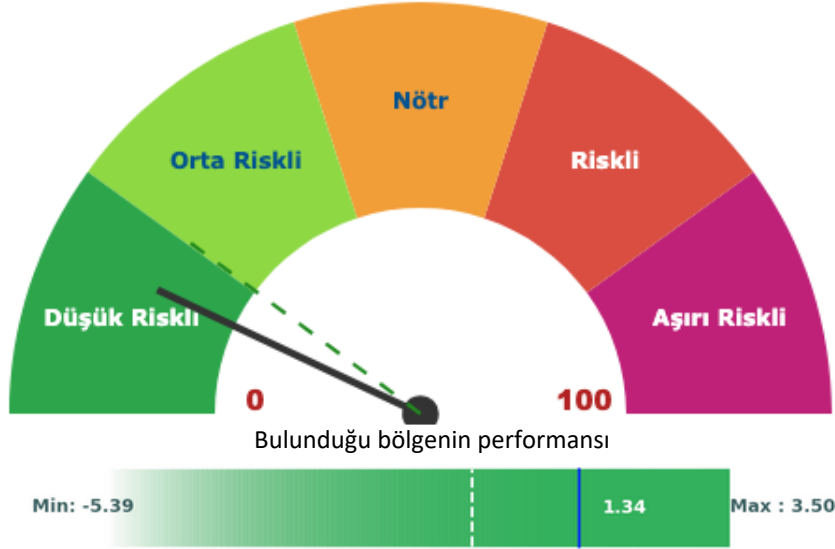
Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda endeks yaklaşık **%17 değer kazanmıştır**. Model bu bölgeye girdiğinden beri endeksin getirisi bu bölgedeki **tarihsel ortalaması yakınındadır**.



DAX

Almanya Hisse Senedi Modeli **düşük riskli bölgeye** geçiş yapmıştır.

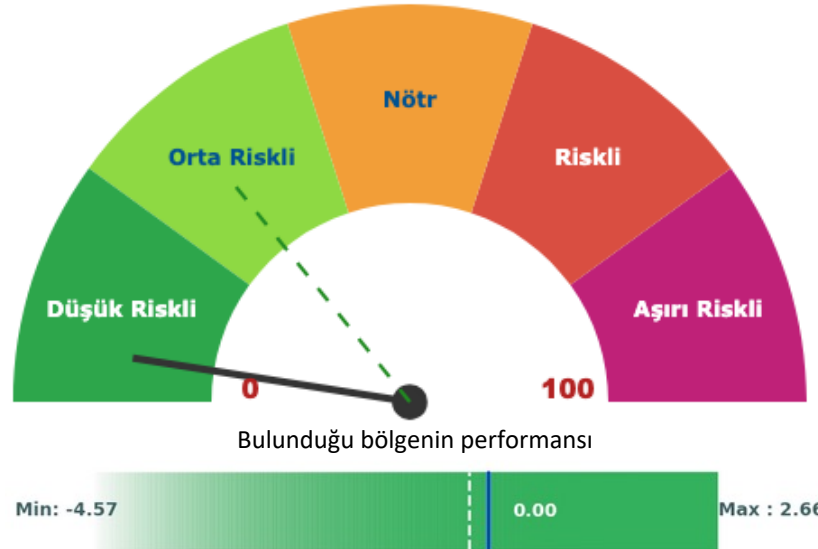
Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda DAX Endeksi yaklaşık **%9.25 değer kazanmıştır**. Model düşük riskli bölgeye girdiğinden beri endeksin getiri performansı bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerindedir**.



NIKKEI

Düşük riskli bölgede bulunan Japonya Hisse Senedi modeli 1 aylık dönemde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

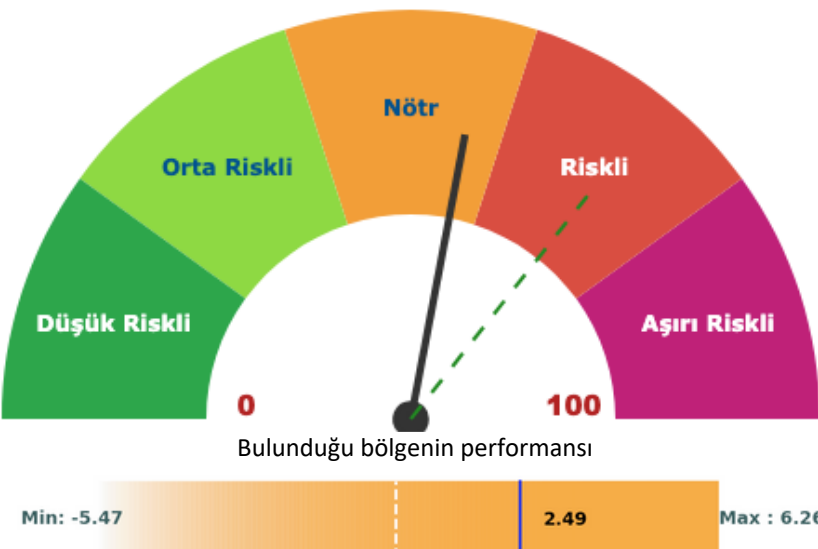
Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda endeks **yaklaşık %6.2 değer kazanmıştır**. Model orta riskli bölgeye girdiğinden beri Nikkei Endeksi getirisi bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır**.



PETROL

Nötr bölgede bulunan Petrol modeli 1 aylık dönemde dalgalı seyretmektedir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada petrol fiyatları **yaklaşık %2.7 değer kazanmıştır**. Model nötr bölgeye girdiğinden beri petrolün getirisi bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde yer almaktadır**.



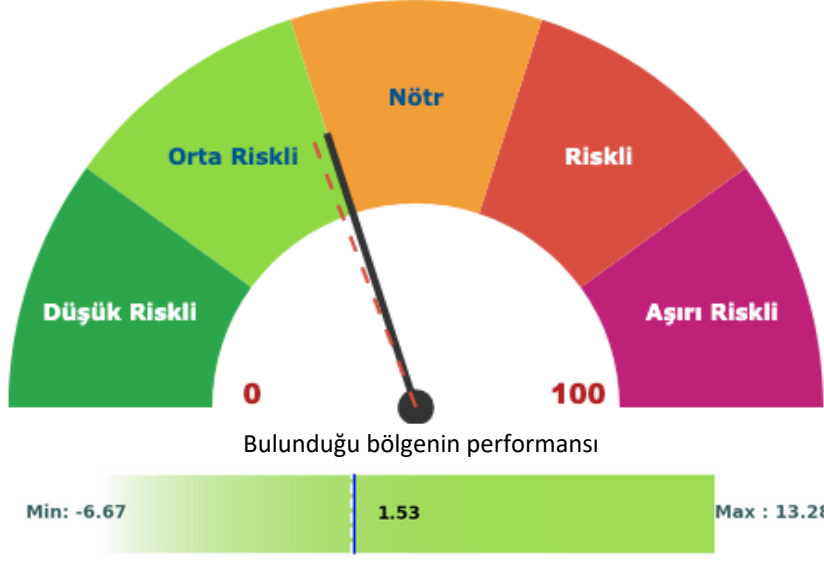
RİSKOMETRE

GÜMÜŞ

19 - 25 Mayıs 2025

1 ayda **orta riskli** bölgede yer alan Gümüş modeli riskli yönde ilerlemeye devam etmektedir.

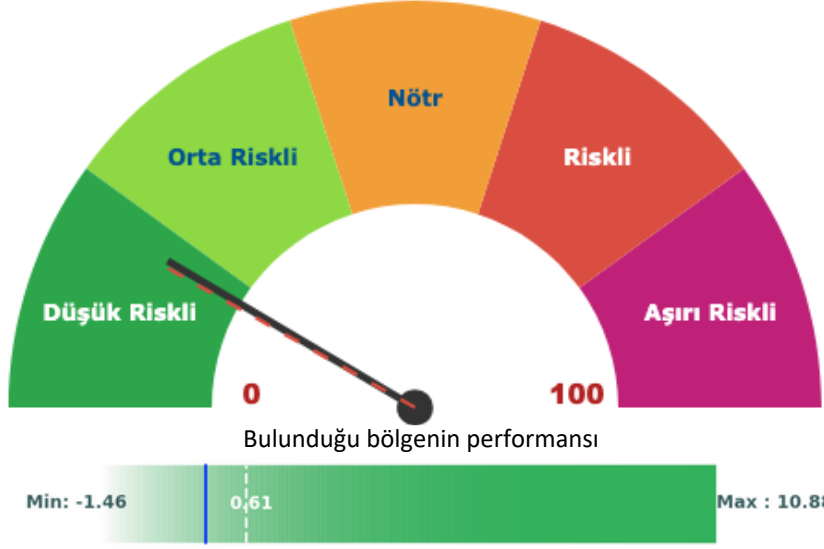
Modelin riskli yönde ilerlediği 1 ayda Gümüş fiyatları yaklaşık **%1 değer kaybetmiştir**. Gümüşün getiri performansı orta riskli bölgedeki **tarihsel ortalamasına yakındır**.



GBPUSD

GBPUSD modeli 1 aylık dönemde **düşük riskli bölgede** riskli yönde ilerlemektedir.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 ayda parite yaklaşık **%0.8 değer kazanmıştır**. GBPUSD parite getirisi düşük riskli bölgeye girdiğinden beri bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında** yer almaktadır.



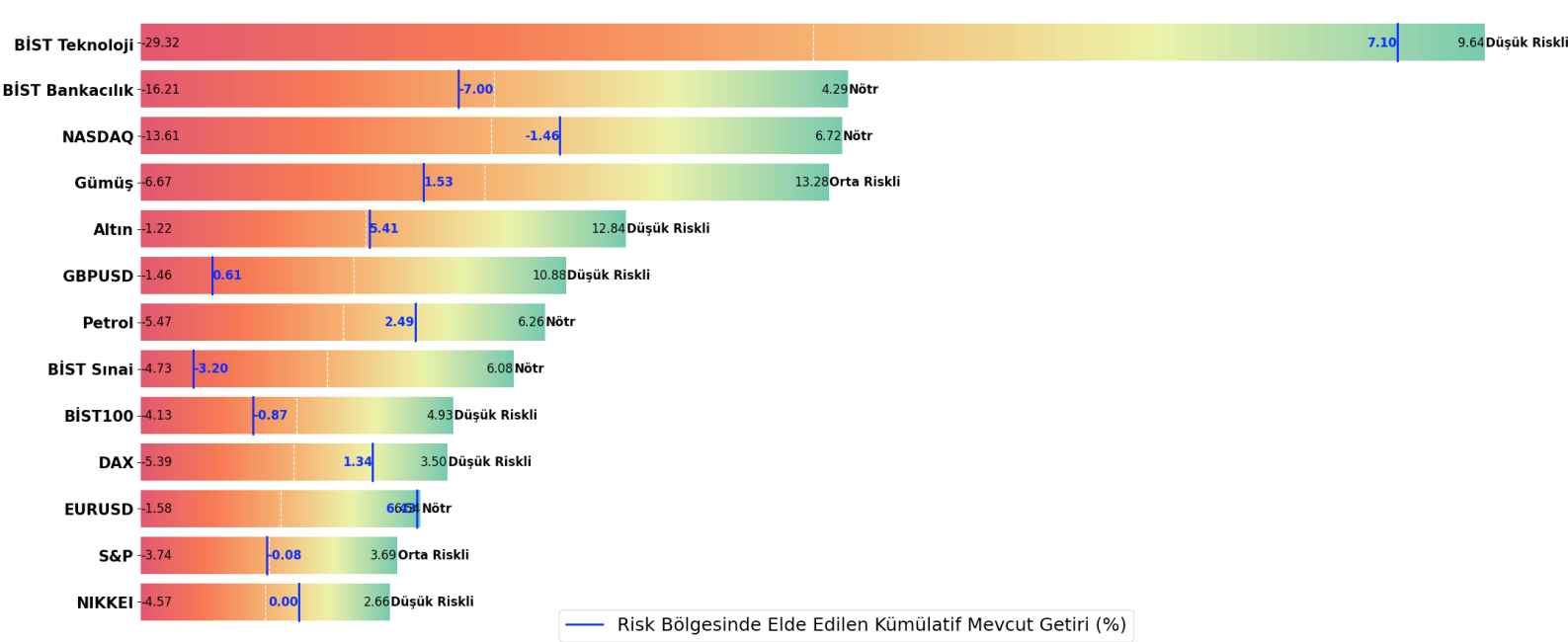
EURUSD

Nötr bölgede bulunan EURUSD Modeli 1 aylık dönemde riskli yönde ilerlemiştir.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 ayda EURUSD paritesi yaklaşık **%1.7 değer kaybetmiştir**. EURUSD parite performansı nötr bölgedeki **tarihsel maksimumuna** yakın bir konumdadır.

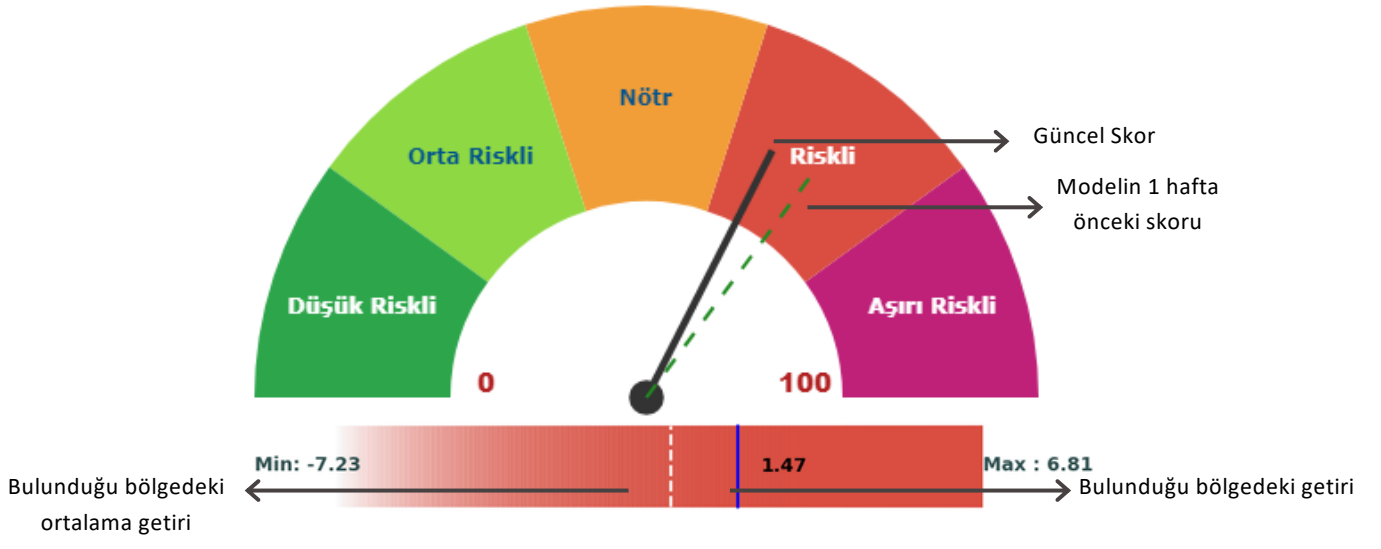


Bulunduğu Bölgeye Göre Getiri Bantları



*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.”