

RİSKOMETRE

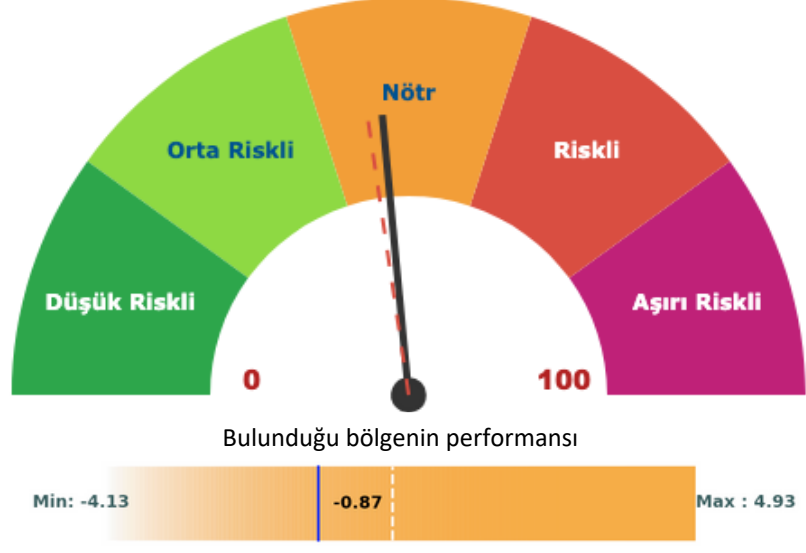
BİST100

5- 11 Mayıs 2025

BİST100 modeli bu hafta **nötr bölge** içinde riskli yönde ilerlemiştir.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftalık dönemde BİST100 Endeksi yaklaşık **%3 değer kaybetmiştir**. Model nötr bölgeye girdiğinden beri BİST100 Endeksi performansı, bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında bulunmaktadır**.

Bu hafta **47** Bir hafta önce **45** Bir ay önce **77**

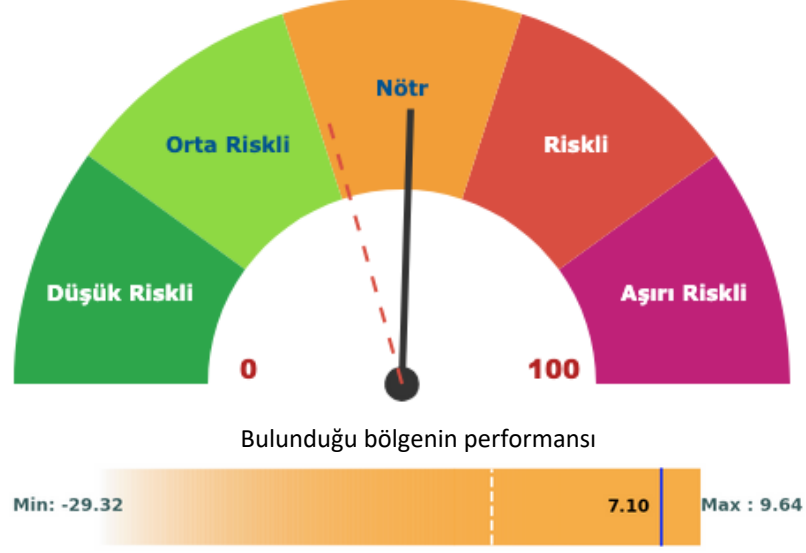


BİST TEKNOLOJİ

1 ayda düşük riskli yöne ilerleyen BİST Teknoloji Modeli bu hafta **nötr bölge** içinde riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda BİST Teknoloji Endeksi yaklaşık **%6.4 değer kazanmıştır**. BİST Teknoloji Endeksi getiri performansı nötr bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır**.

Bu hafta **51** Bir hafta önce **41** Bir ay önce **78**

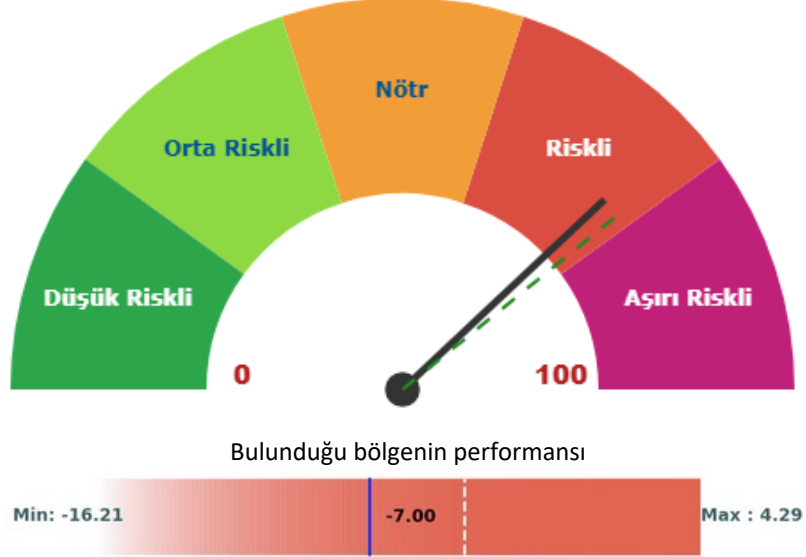


BİST BANKACILIK

BİST Bankacılık modeli bu hafta **riskli bölge** içinde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

BİST Bankacılık Endeksi modelin riskli sinyali verdiği 1 haftada **%2.1 değer kaybetmiştir**. Model riskli bölgeye girdiğinden beri endeksin performansı bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altındadır**.

Bu hafta **76** Bir hafta önce **78** Bir ay önce **100**

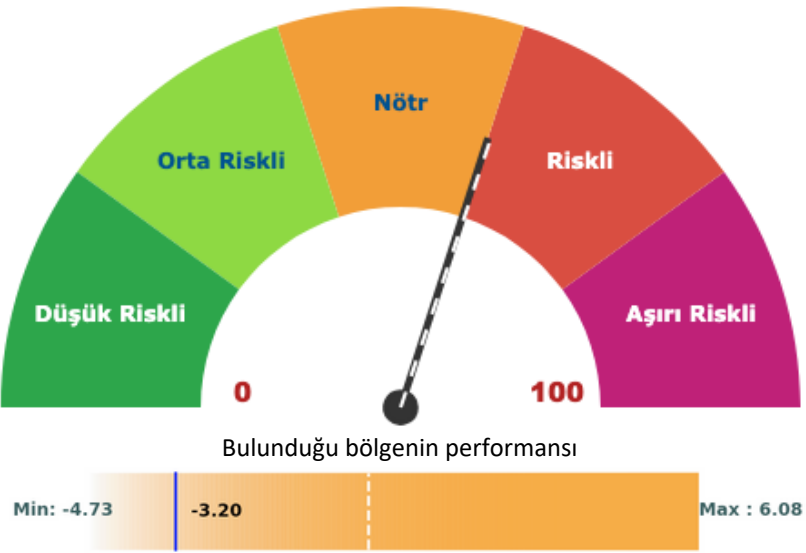


BİST SİNAİ

BİST Sınai modeli bu hafta **nötr bölgede** konumunu korumuştur.

Modelin nötr sinyal verdiği 1 haftada endeks yaklaşık **%1.5 değer kaybetmiştir**. Model nötr bölgeye girdiğinden beri BİST Sınai Endeksi performansı bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında yer almaktadır**.

Bu hafta **60** Bir hafta önce **60** Bir ay önce **86**

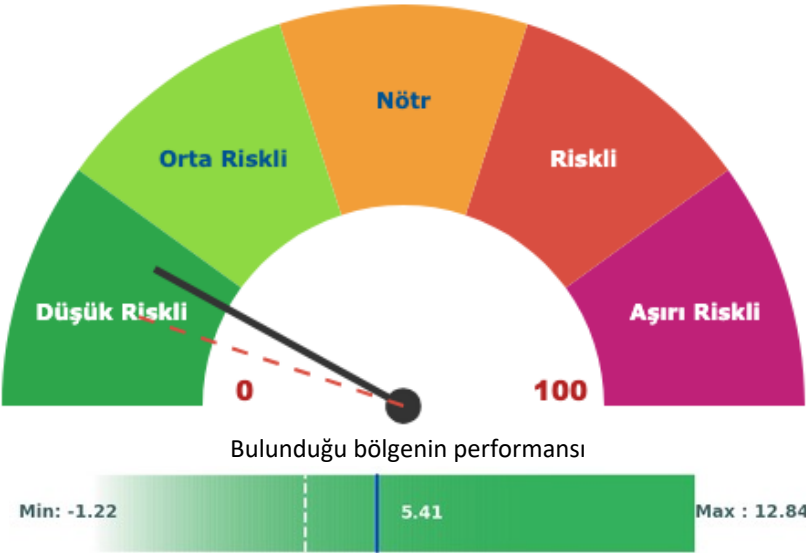


ALTIN

1 aylık dönemde **düşük riskli** bölge içinde yer alan Altın modeli bu hafta riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftada Altın fiyatları yaklaşık **%2 değer kaybetmiştir**. Model düşük riskli bölgeye girdiğinden beri Altının getirisi bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerindedir**.

Bu hafta **16** Bir hafta önce **10** Bir ay önce **13**



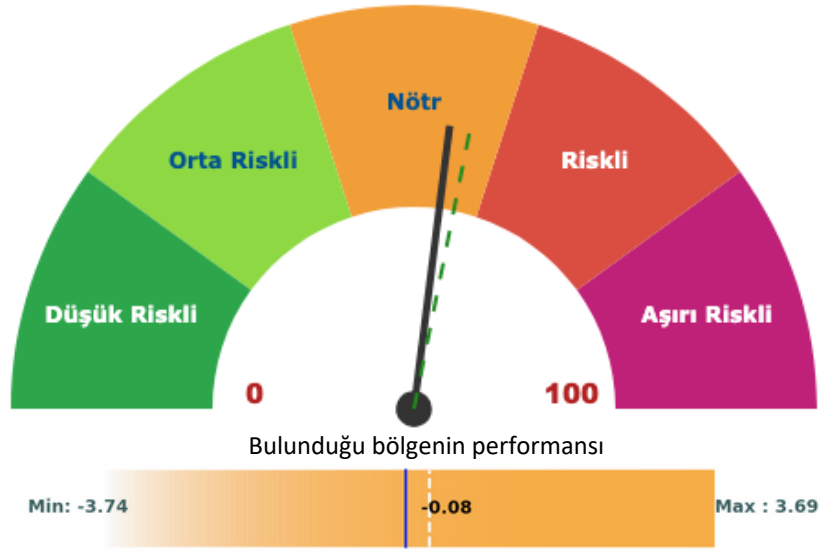
RİSKOMETRE

S&P

5- 11 Mayıs 2025

Nötr bölgede bulunan ABD Hisse Senedi Modeli 1 aylık dönemde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

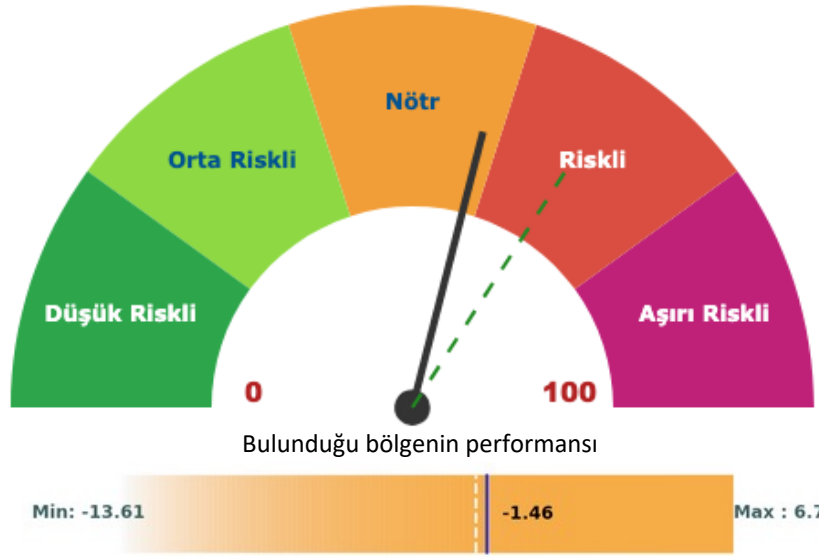
Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda endeks yaklaşık **%3.9 değer kazanmıştır**. Endeksin getiri performansı nötr bölgeye girdiğinden beri bu bölgedeki **ortalamasının altında bulunmaktadır**.



NASDAQ

1 aylık dönemde düşük riskli yönde ilerleyen Nasdaq Modeli bu hafta **nötr bölgeye** geçiş yapmıştır.

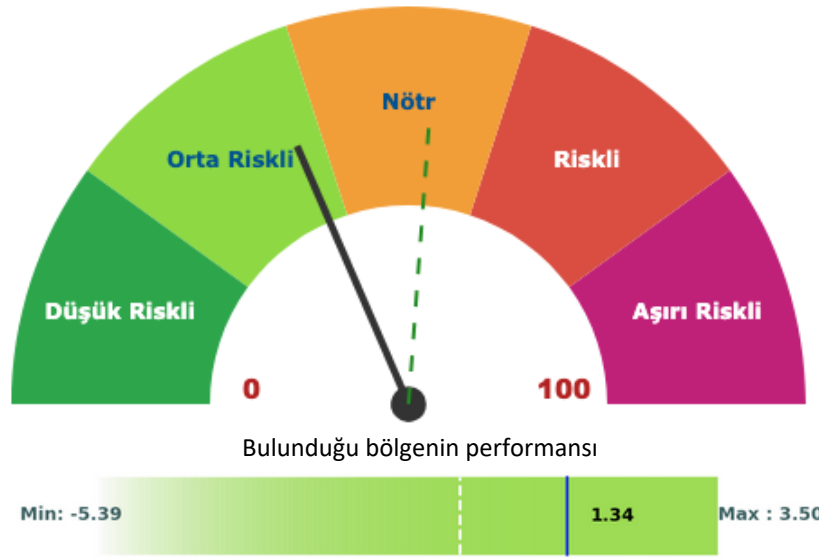
Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada endeks yaklaşık **%3 değer kazanmıştır**. Model nötr bölgeye girdiğinden beri endeksin getirisi bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının hafif üzerindedir**.



DAX

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

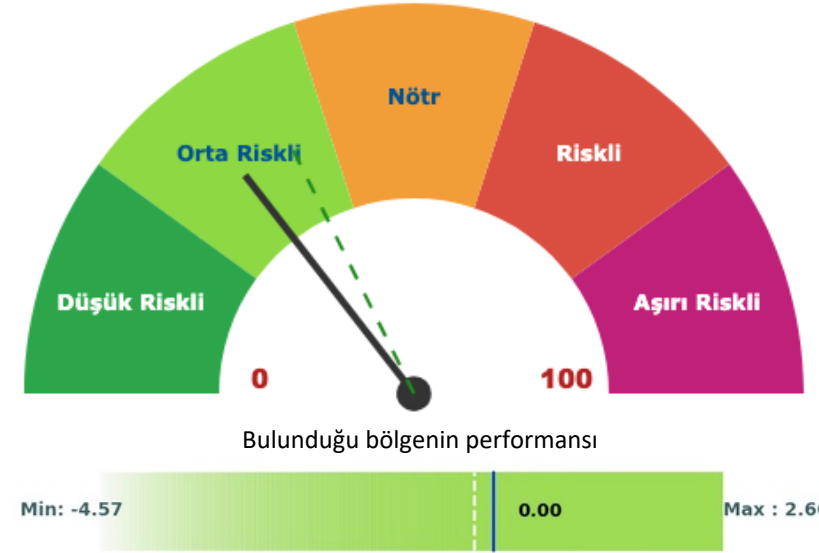
Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda DAX Endeksi yaklaşık **%7.4 değer kazanmıştır**. Model orta riskli bölgeye girdiğinden beri endeksin getiri performansı bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerindedir**.



NIKKEI

Japonya Hisse Senedi 1 aylık dönemde **orta riskli bölgede** dalgalı seyretmektedir.

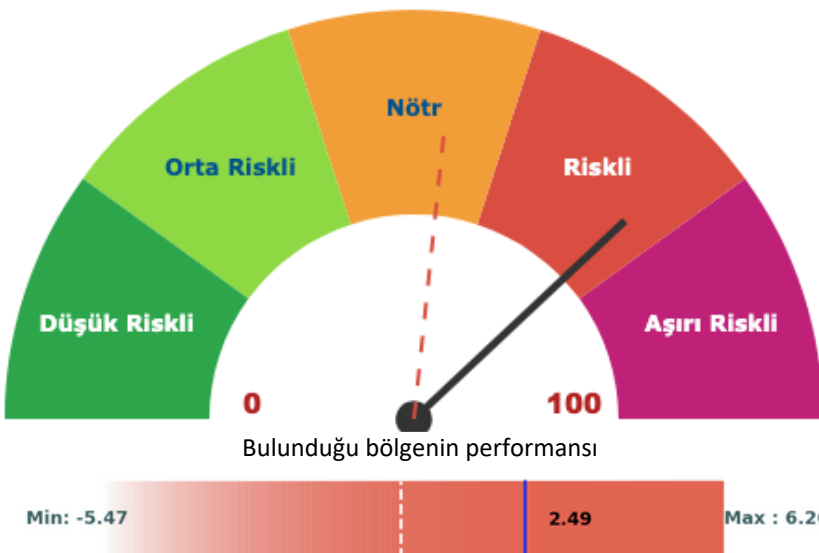
Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 haftada Nikkei Endeksi **yaklaşık %1.3 değer kazanmıştır**. Model orta riskli bölgeye girdiğinden beri Nikkei Endeksi getirisi bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır**.



PETROL

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

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



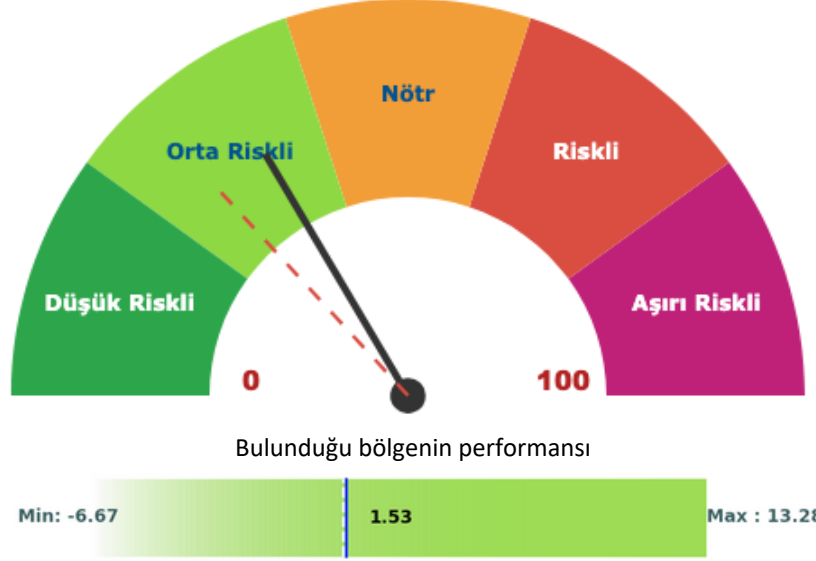
RİSKOMETRE

GÜMÜŞ

5- 11 Mayıs 2025

1 ayda **orta riskli** bölgede yer alan Gümüş modeli riskli yöne ilerlemiştir.

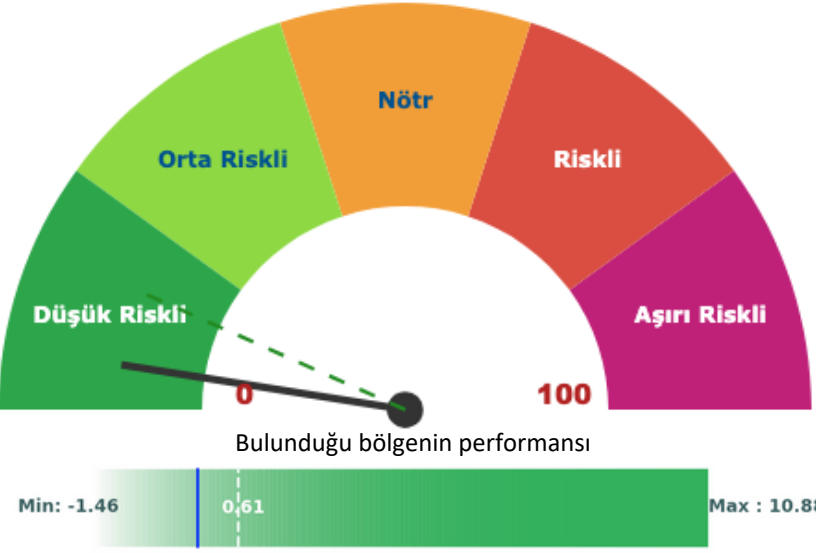
Modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftada Gümüş fiyatları yaklaşık **%1.8 değer kaybetmiştir**. Gümüşün getiri performansı orta riskli bölgedeki **tarihsel ortalamasına yakın bir konumda bulunmaktadır**.



GBPUSD

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

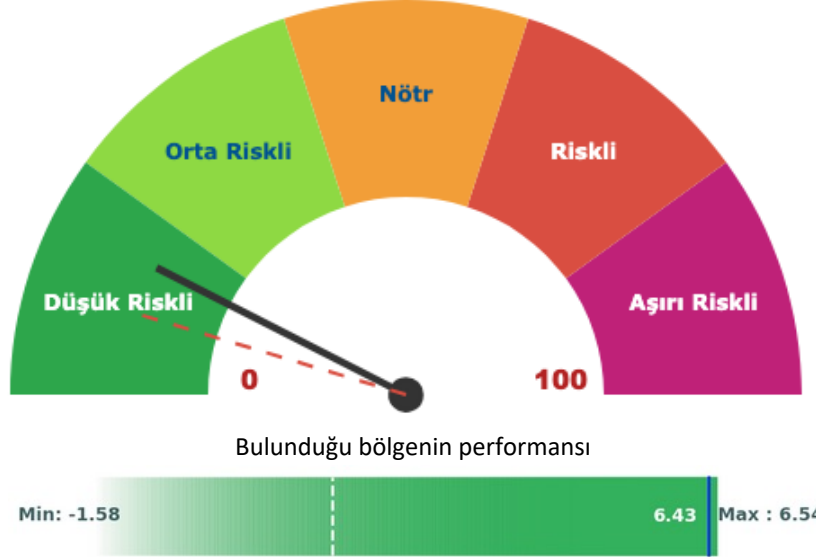
Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda parite yaklaşık **%3.3 değer kazanmıştır**. GBPUSD parite getirisi düşük riskli bölgeye girdiğinden beri bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında yer almaktadır**.



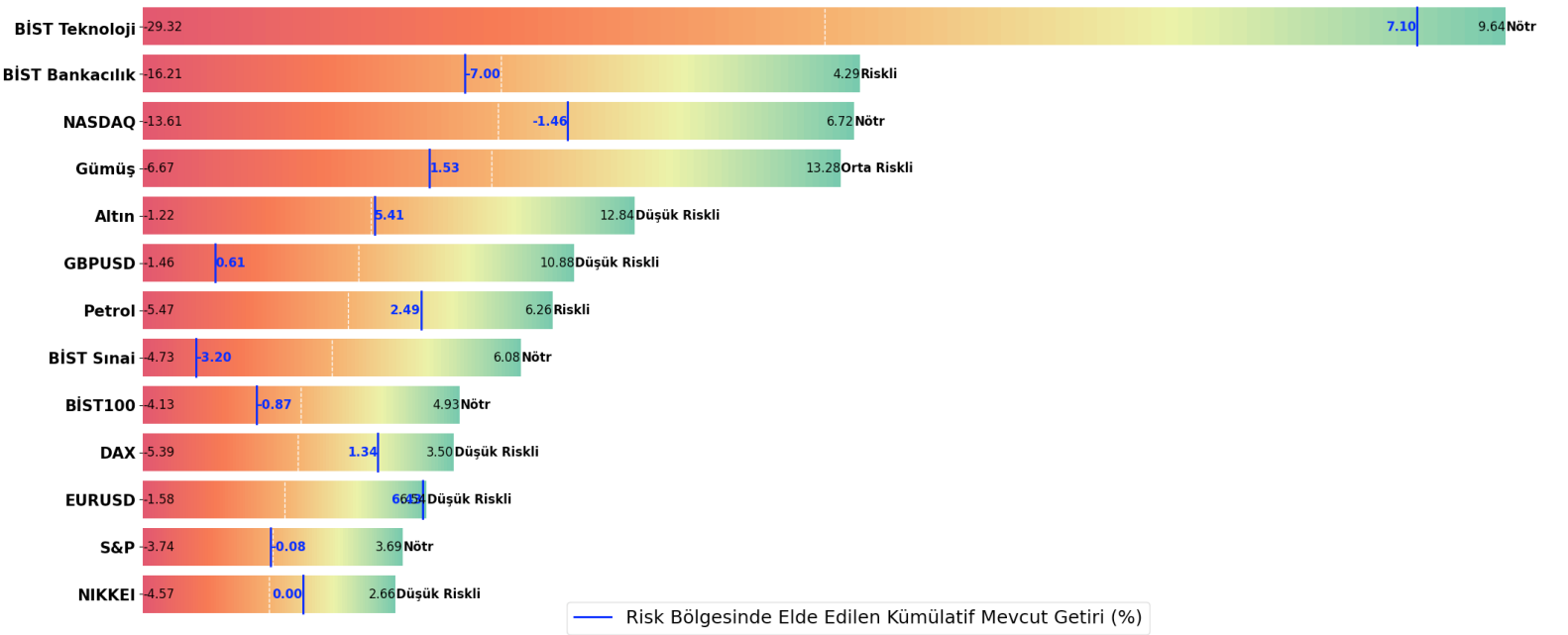
EURUSD

1 aylık dönemde **düşük riskli bölgede** dalgalı seyreden EURUSD Modeli bu hafta riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftada EURUSD paritesi yaklaşık **%0.5 değer kaybetmiştir**. EURUSD parite performansı düşük riskli bölgedeki **tarihsel maksimum değeri yakınında bulunmaktadır**.

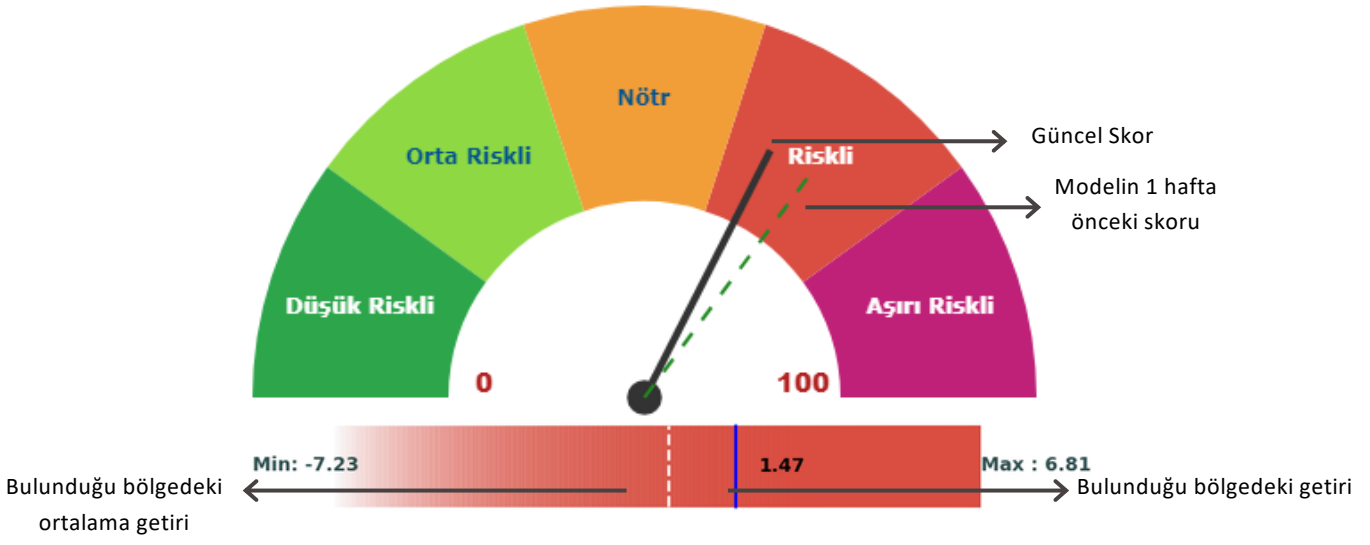


Bulunduğu Bölgeye Göre Getiri Bantları



*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.”