

RİSKOMETRE

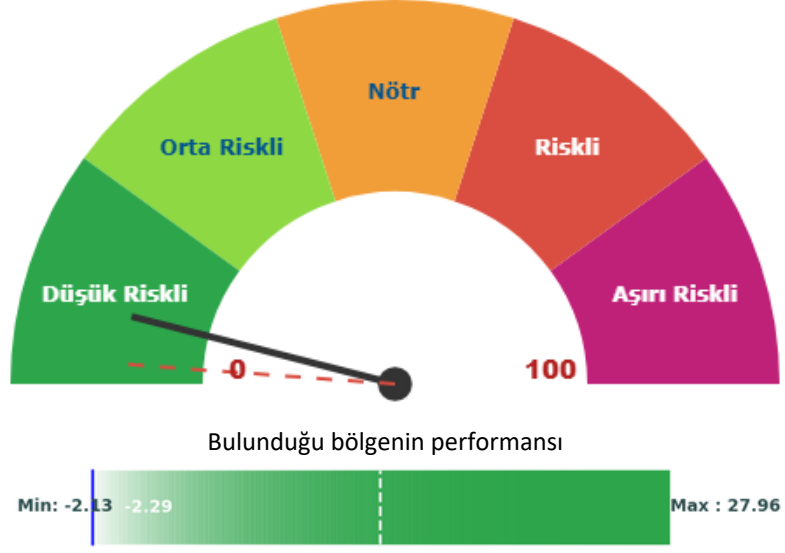
BİST100

23 - 29 Haziran 2025

BİST100 modeli 1 aylık dönemde **düşük riskli** bölge içinde riskli yönde ilerlemiştir.

Modelin düşük riskli bölgede bulunduğu 1 ayda BİST100 Endeksi yaklaşık **%1.8 değer kaybetmiştir**. Model düşük riskli bölgeye girdiğinden beri BİST100 Endeksi performansı, bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında bulunmaktadır**.

Bu hafta **8** Bir hafta önce **2** Bir ay önce **1**

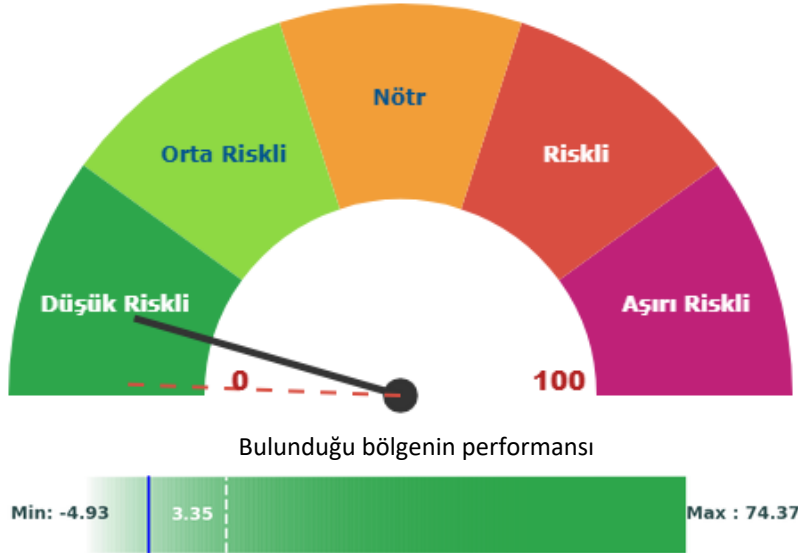


BİST TEKNOLOJİ

BİST Teknoloji Modeli 1 ayda **düşük riskli bölge** içinde dalgalanmaktadır.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda BİST Teknoloji Endeksi **yaklaşık %4.8 değer kazanmıştır**. BİST Teknoloji Endeksi getiri performansı bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında bulunmaktadır**.

Bu hafta **9** Bir hafta önce **1** Bir ay önce **19**



BİST BANKACILIK

Orta riskli bölgede bulunan BİST Bankacılık modeli 1 aylık dönemde düşük riskli yönde ilerlemiştir.

BİST Bankacılık Endeksi modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda yaklaşık **%5.4 değer kazanmıştır**. Model bu bölgeye girdiğinden beri endeksin performansı bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altındadır**.

Bu hafta **28** Bir hafta önce **27** Bir ay önce **45**

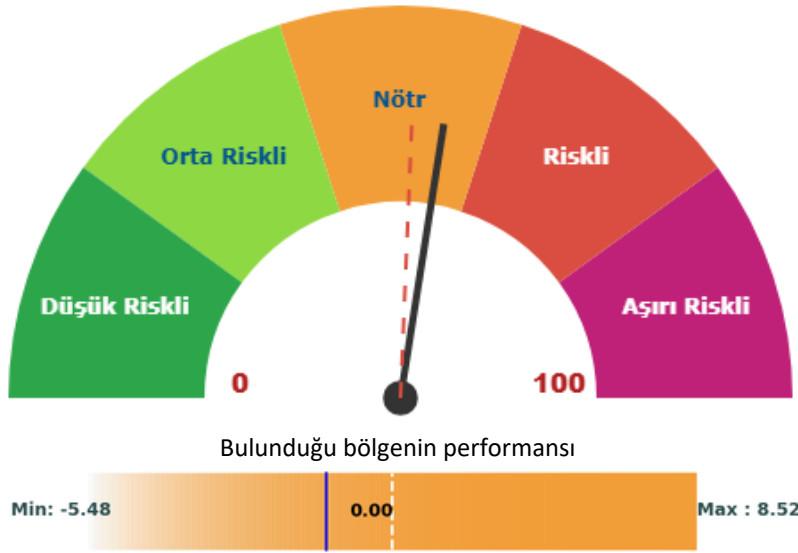


BİST SİNAİ

BİST Sınai modeli **nötr bölgede** riskli yönde ilerlemiştir.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftada endeks **yaklaşık %0.5 değer kazanmıştır**. Model nötr bölgeye girdiğinden beri BİST Sınai Endeksi performansı bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında yer almaktadır**.

Bu hafta **55** Bir hafta önce **51** Bir ay önce **67**

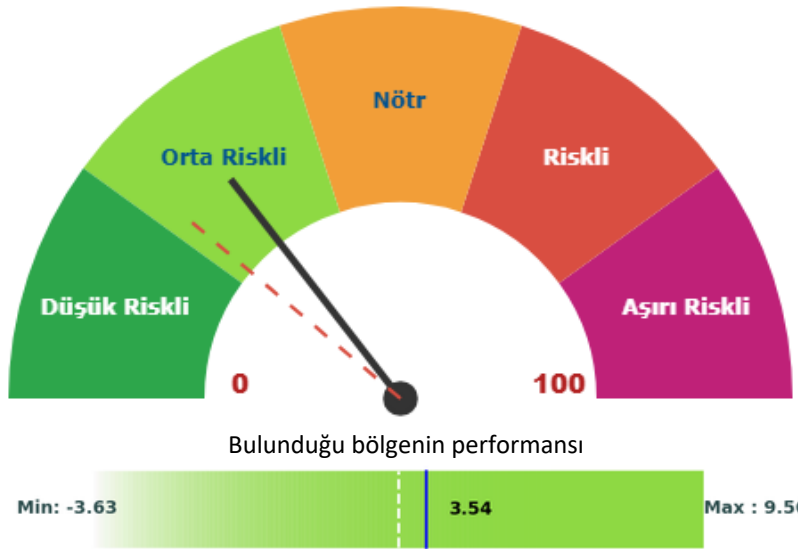


ALTIN

Orta riskli bölgede bulunan Altın modeli 1 ay önceki konumuna dönmüştür.

Modelin riskli yönde ilerlediği 1 haftada Altın fiyatları **yaklaşık %2.3 değer kaybetmiştir**. Model orta riskli bölgeye girdiğinden beri Altının getirisi bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerindedir**.

Bu hafta **29** Bir hafta önce **22** Bir ay önce **29**



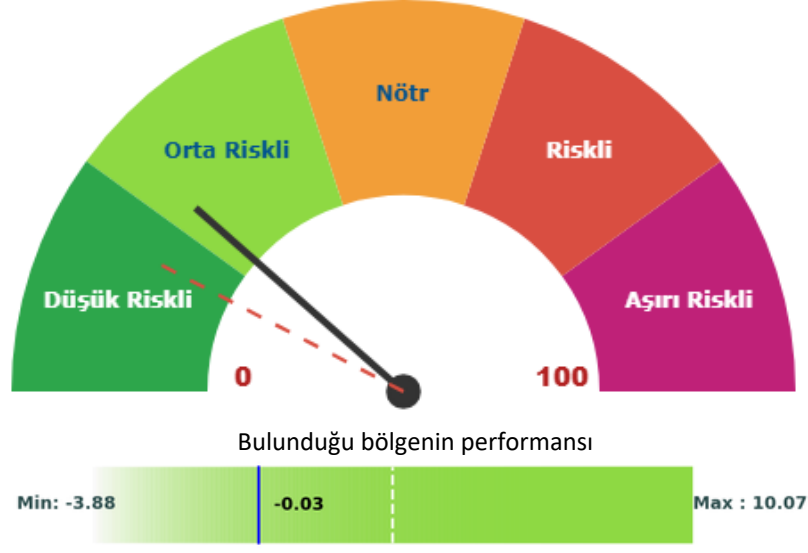
RİSKOMETRE

S&P

23 - 29 Haziran 2025

ABD Hisse Senedi Modeli bu hafta riskli yönde ilerleyerek **orta riskli bölgeye** geçiş yapmıştır.

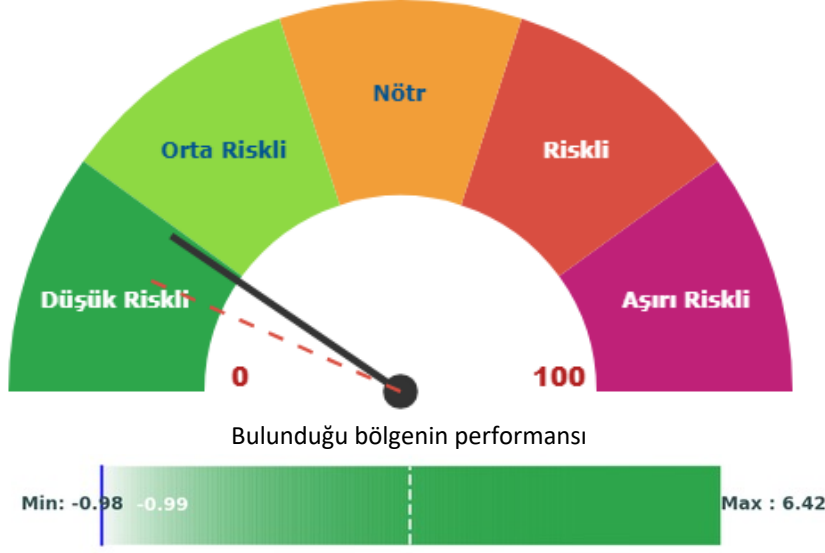
Modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftada endeks yaklaşık **%0.7 değer kaybetmiştir**. Endeksin getiri performansı orta riskli bölgeye girdiğinden beri bu bölgedeki **ortalamasının altında bulunmaktadır**.



NASDAQ

Düşük riskli bölgede bulunan Nasdaq Modeli bu hafta riskli yönde ilerlemiştir.

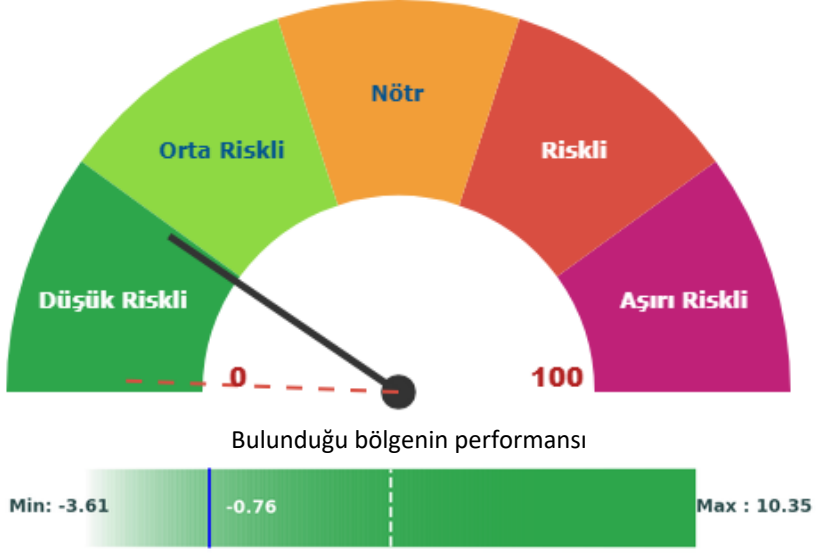
Modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftada endeks yaklaşık **%0.6 değer kaybetmiştir**. Model bu bölgeye girdiğinden beri endeksin getirisi bu bölgedeki **tarihsel minimumuna yakındır**.



DAX

Düşük riskli bölgede bulunan Almanya Hisse Senedi Modeli bu hafta riskli yönde ilerlemiştir.

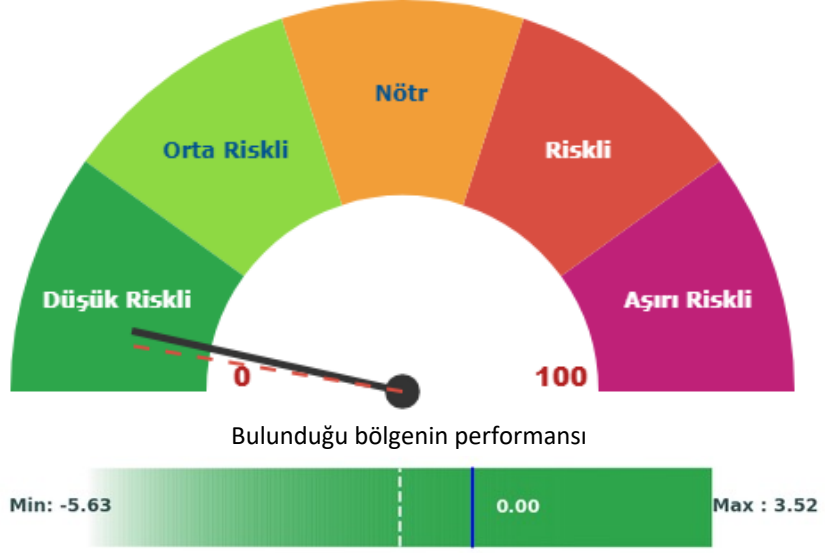
Modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftada DAX Endeksi yaklaşık **%4.3 değer kaybetmiştir**. Model düşük riskli bölgeye girdiğinden beri endeksin getiri performansı bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altındadır**.



NIKKEI

Düşük riskli bölgede bulunan Japonya Hisse Senedi modeli 1 aylık dönemde düşük riskli bölge içinde dalgalanmaktadır.

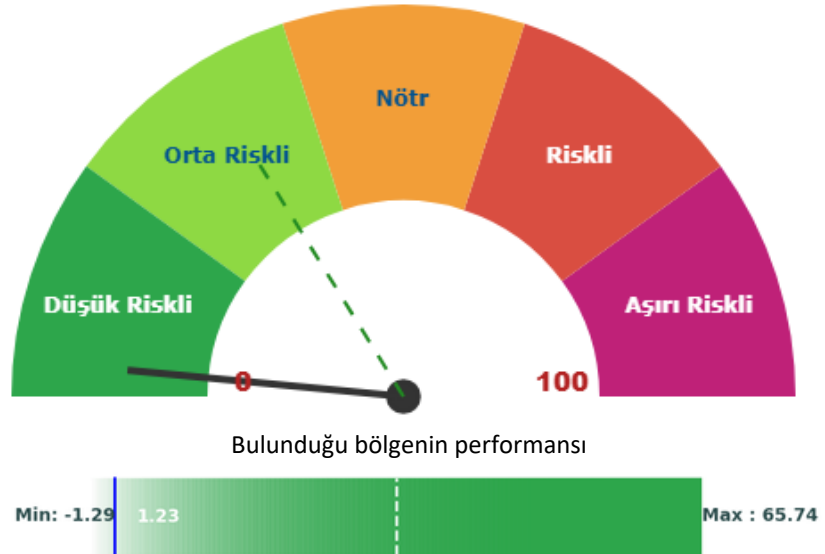
Modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftada endeks yaklaşık **%0.8 değer kaybetmiştir**. Model düşük riskli bölgeye girdiğinden beri Nikkei Endeksi getirisi bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır**.



PETROL

Petrol modeli 1 aylık dönemde düşük riskli yönde ilerleyerek düşük **riskli bölgeye** geçiş yapmıştır.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda petrol fiyatları yaklaşık **%19.2 değer kazanmıştır**. Model düşük riskli bölgeye girdiğinden beri petrolün getirisi bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında yer almaktadır**.



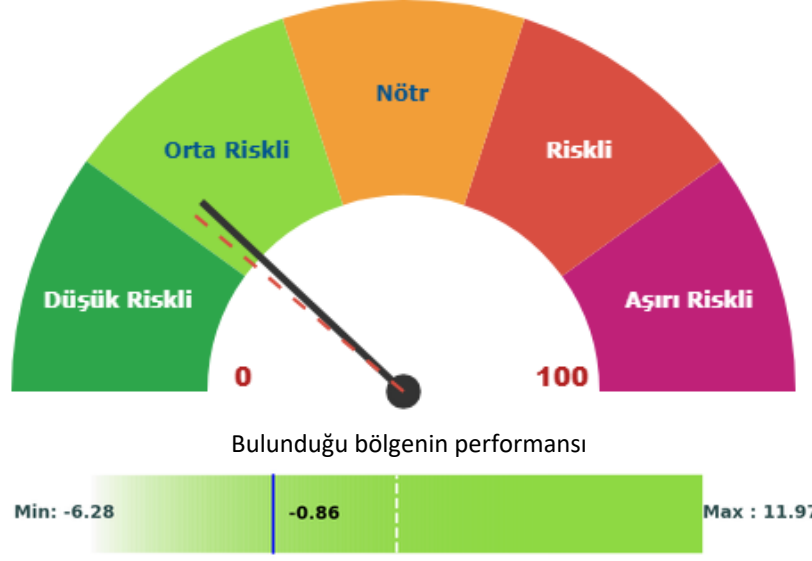
RİSKOMETRE

GÜMÜŞ

23 - 29 Haziran 2025

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

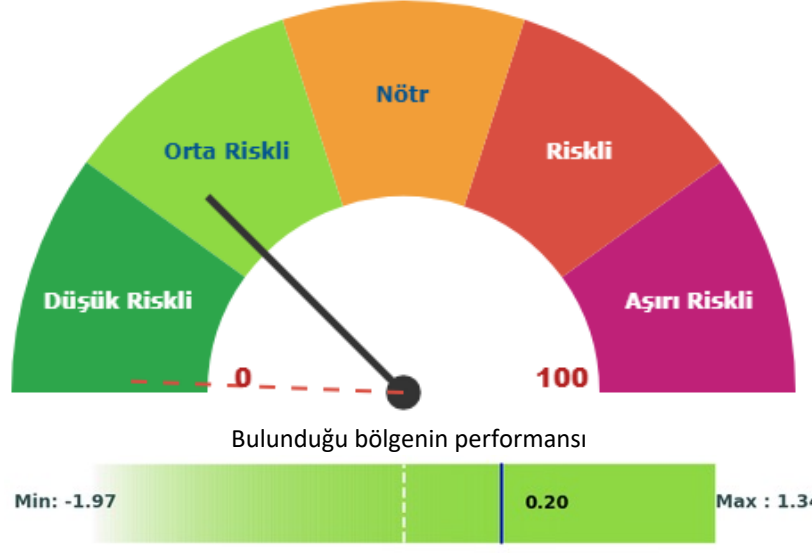
Modelin düşük riskli yönde ilerlediği 1 ayda Gümüş fiyatları yaklaşık **%7.9 değer kazanmıştır**. Gümüşün getiri performansı orta riskli bölgedeki **tarihsel ortalamasının altındadır**.



GBPUSD

GBPUSD modeli riskli yönde ilerleyerek **orta riskli bölgeye** geçmiştir.

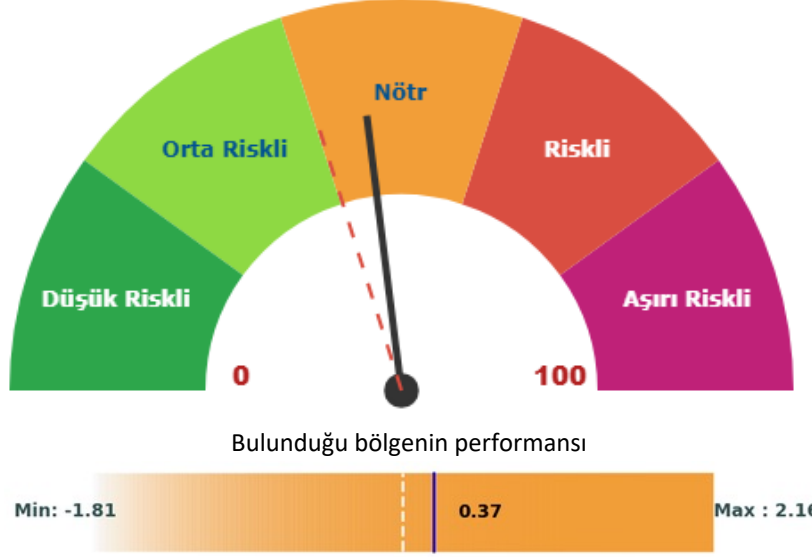
Modelin riskli yöne ilerlediği 1 ayda parite yaklaşık **%0.5 değer kaybetmiştir**. GBPUSD parite getirisi orta riskli bölgeye girdiğinden beri bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerindedir**.



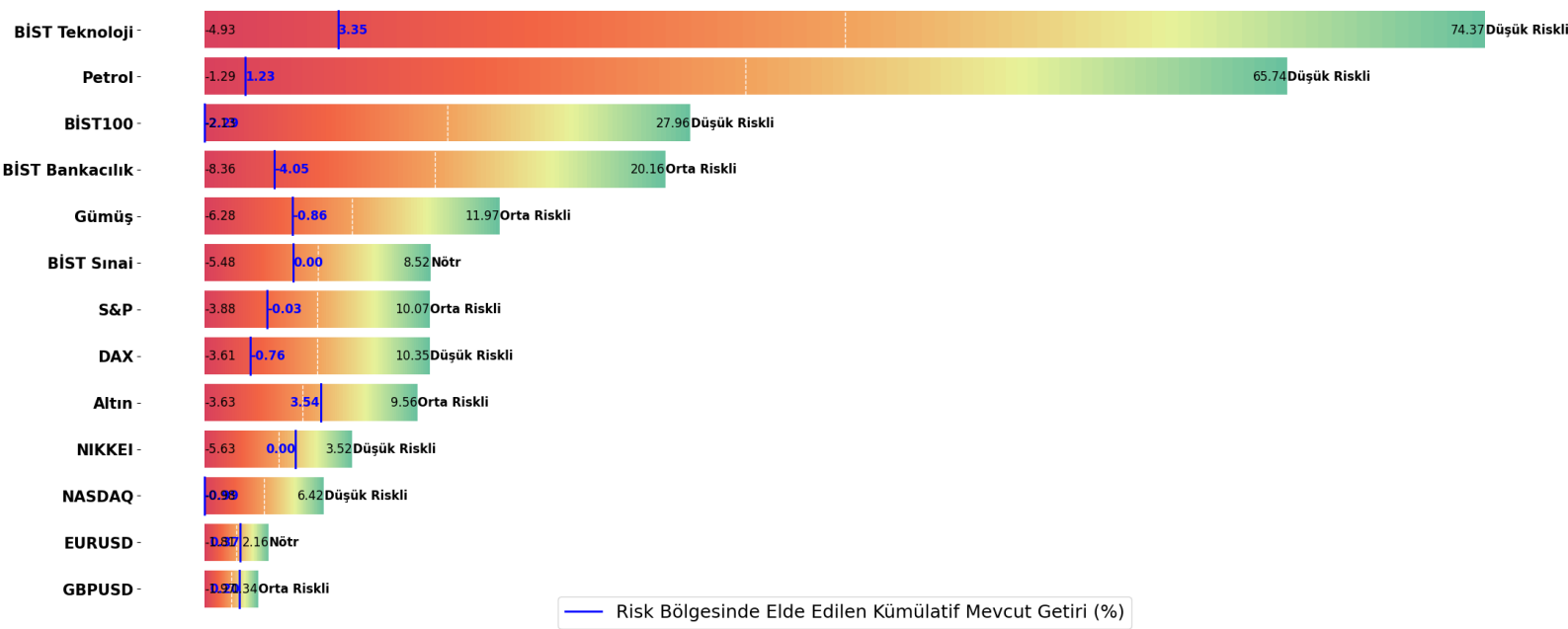
EURUSD

EURUSD Modeli 1 aylık dönemde **nötr bölge** içinde dalgalanmaktadır.

Modelin riskli yönde ilerlediği 1 haftada EURUSD paritesi yaklaşık **%0.2 değer kaybetmiştir**. EURUSD parite performansı nötr bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerindedir**.

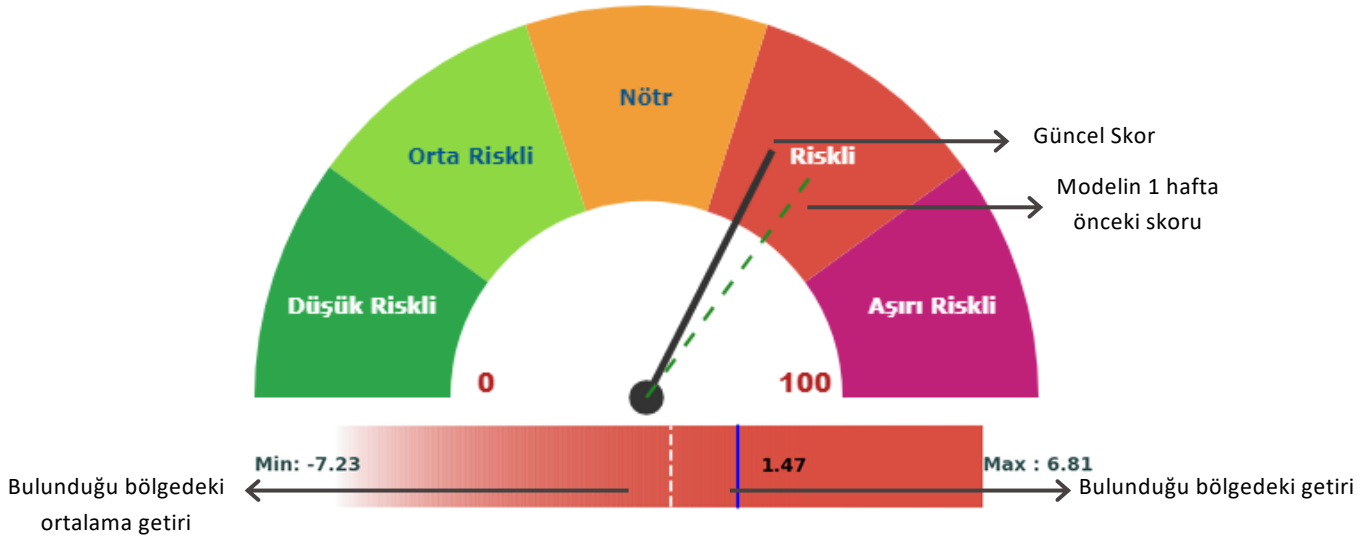


Bulunduğu Bölgeye Göre Getiri Bantları



*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.”