

RİSKOMETRE

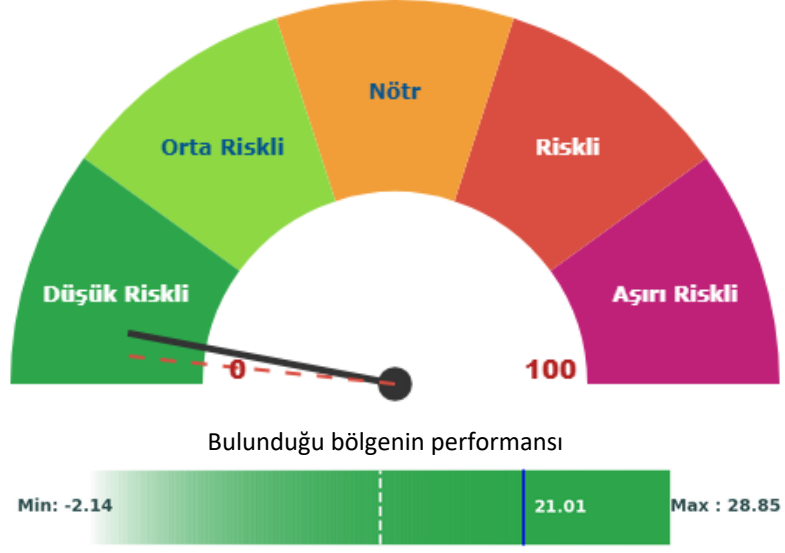
BIST100

25 - 31 Ağustos 2025

BİST100 modeli 1 aylık dönemde **düşük riskli bölgede** bulunmaktadır.

Modelin düşük riskli yönde ilerlediği 1 ayda endeks yaklaşık **%7.5 değer kazanmıştır**. Model düşük riskli bölgeye girdiğinden beri BIST100 Endeksi performansı, bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır**.

Bu hafta **6** Bir hafta önce **3** Bir ay önce **12**

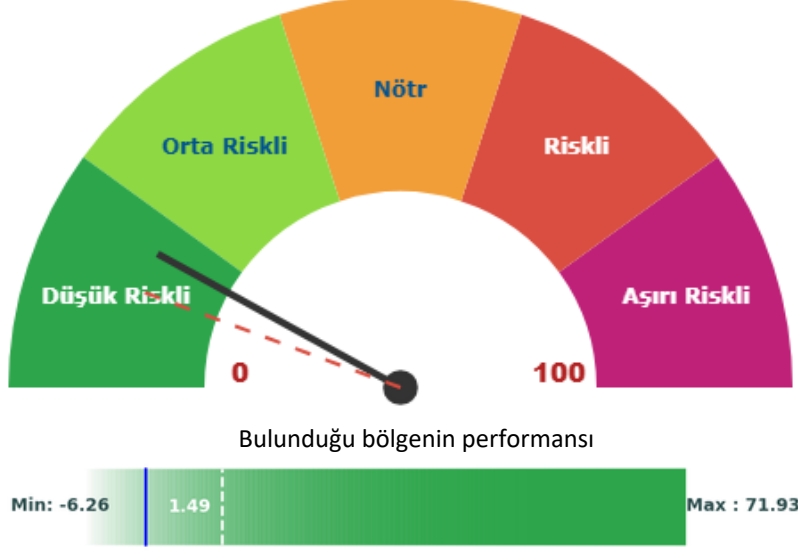


BIST TEKNOLOJİ

BİST Teknoloji Modeli 1 aylık dönemde **düşük riskli bölge** içinde riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin düşük riskli bölgede yer aldığı 1 haftalık dönemde BİST Teknoloji Endeksi **yaklaşık %5.8 değer kazanmıştır**. BIST Teknoloji Endeksi getiri performansı bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altındadır**.

Bu hafta **16** Bir hafta önce **11** Bir ay önce **1**

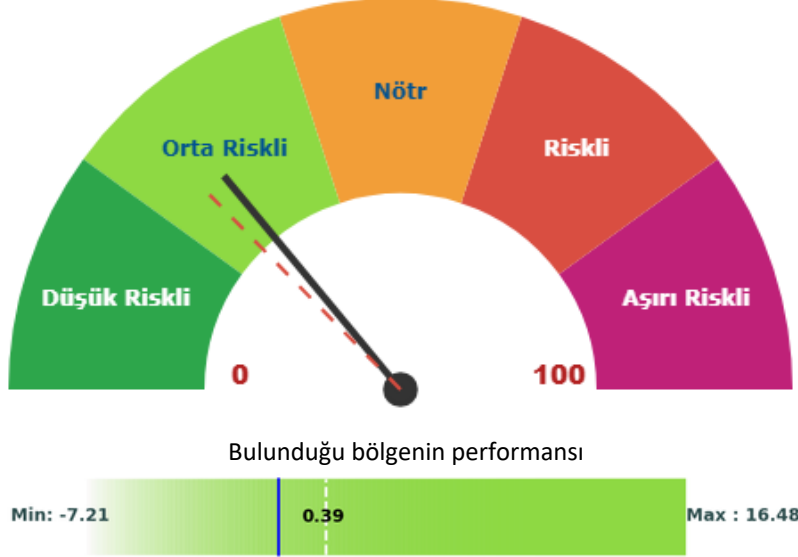


BIST BANKACILIK

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

Modelin orta risk sinyali verdiği 1 haftalık dönemde BİST Bankacılık Endeksi **yaklaşık %3.3 değer kazanmıştır**. Model orta riskli bölgeye girdiğinden beri endeksin performansı bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altındadır**.

Bu hafta **28** Bir hafta önce **25** Bir ay önce **17**

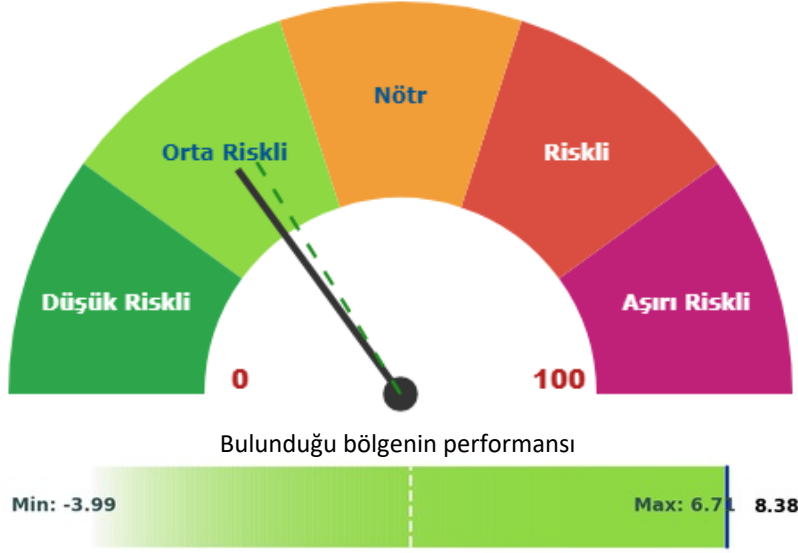


BIST SİNAİ

BIST Sınai modeli 1 aylık dönemde **orta riskli bölge** içinde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda endeks **yaklaşık %9.6 değer kazanmıştır**. Model orta riskli bölgeye girdiğinden beri BIST Sınai Endeksi performansı bu bölgedeki **tarihsel maksimum değerinde bulunmaktadır**.

Bu hafta **30** Bir hafta önce **32** Bir ay önce **38**

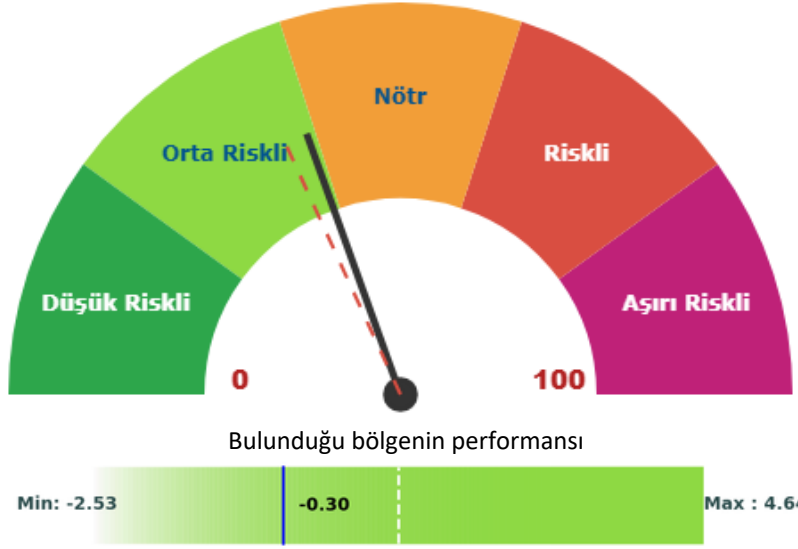


ALTIN

1 aylık dönemde **orta riskli bölgede** yer alan Altın Modeli riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin riskli yönde ilerlediği 1 ayda Altın fiyatları **yaklaşık %1.7 değer kaybı yaşamıştır**. Model orta riskli bölgeye girdiğinden beri Altının getirisi orta riskli bölgedeki **tarihsel ortalamasının altındadır**.

Bu hafta **39** Bir hafta önce **36** Bir ay önce **35**



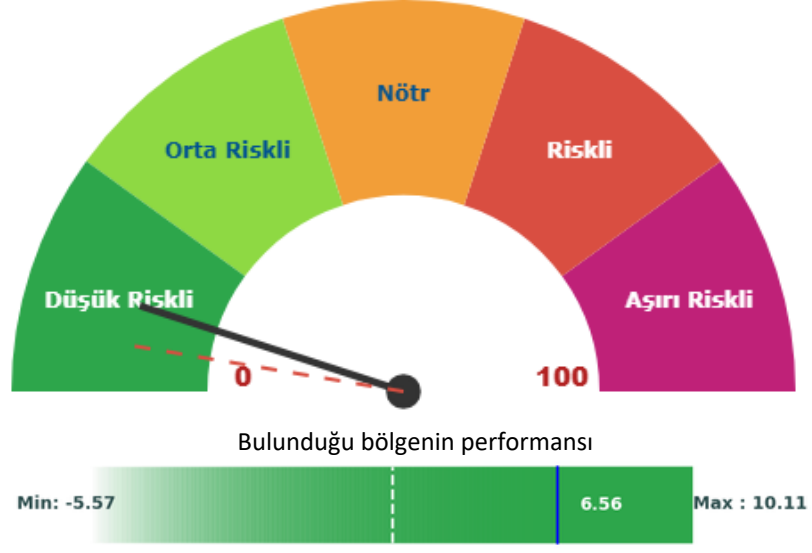
RİSKOMETRE

S&P

25 - 31 Ağustos 2025

ABD Hisse Senedi Modeli 1 aylık dönemde **düşük riskli bölge** içinde riskli yöne ilerlemiştir.

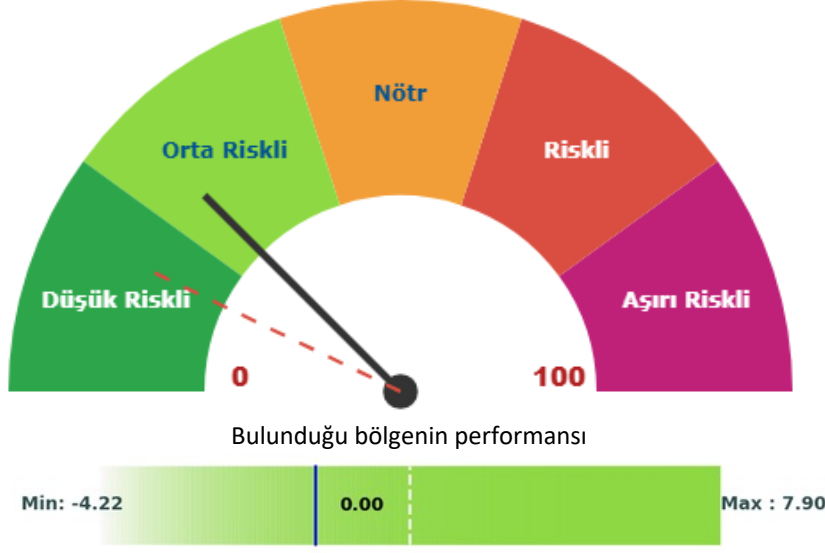
Modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftada endeks yaklaşık **%1.5 değer kaybetmiştir**. Endeksin getiri performansı düşük riskli bölgeye girdiğinden beri bu bölgedeki tarihsel **ortalamasının üzerinde bulunmaktadır**.



NASDAQ

Nasdaq Modeli bu hafta düşük riskli bölgeden **orta riskli bölgeye** geçiş yapmıştır.

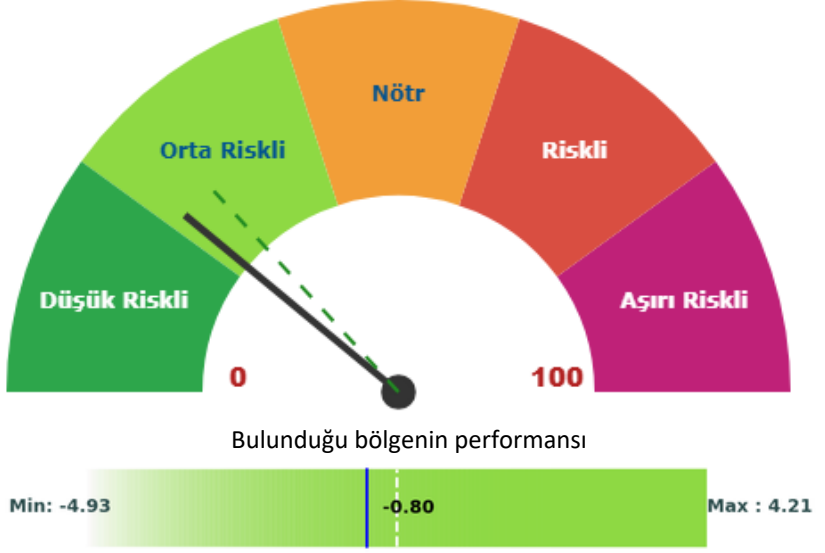
Modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftada endeks yaklaşık **%2.9 değer kaybetmiştir**. Model orta riskli bölgeye girdiğinden beri endeksin getirisi orta riskli bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında bulunmaktadır**.



DAX

1 aylık dönemde **orta riskli bölge** içinde yer alan Almanya Hisse Senedi modeli bu hafta 1 ay önceki konumuna dönüş yapmıştır.

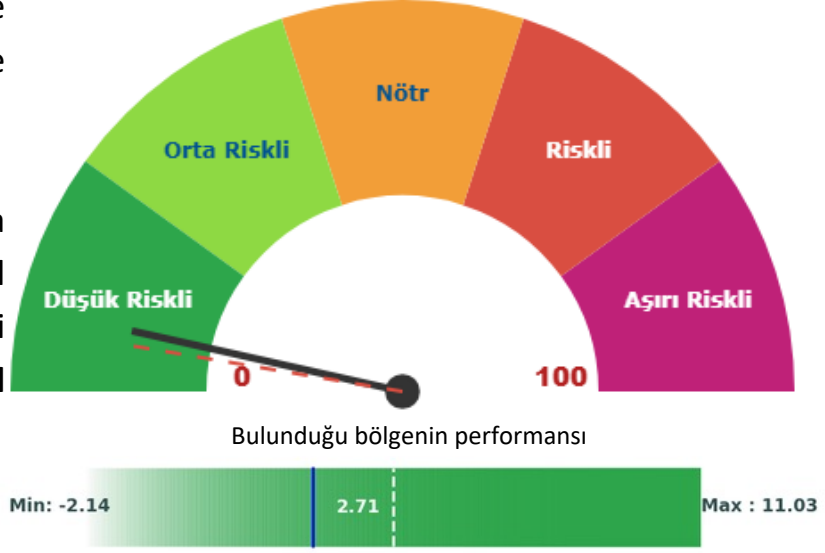
Modelin dalgalı seyrettiği 1 ayda DAX Endeksi yaklaşık **%0.8 değer kaybetmiştir**. Model orta riskli bölgeye girdiğinden beri endeksin getiri performansı orta riskli bölgedeki **tarihsel ortalamasının altındadır**.



NIKKEI

Japonya Hisse Senedi modeli 1 aylık dönemde **düşük riskli bölge** içinde düşük riskli yöne ilerlemiştir.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda **endeks yaklaşık %7.8 değer kazanmıştır**. Model düşük riskli bölgeye girdiğinden beri Nikkei Endeksi getirisi bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında bulunmaktadır**.



PETROL

1 aylık dönemde riskli yönde ilerleyen Petrol modeli bu hafta düşük riskli yöne ilerleyerek **nötr bölgeye** geçiş yapmıştır.

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



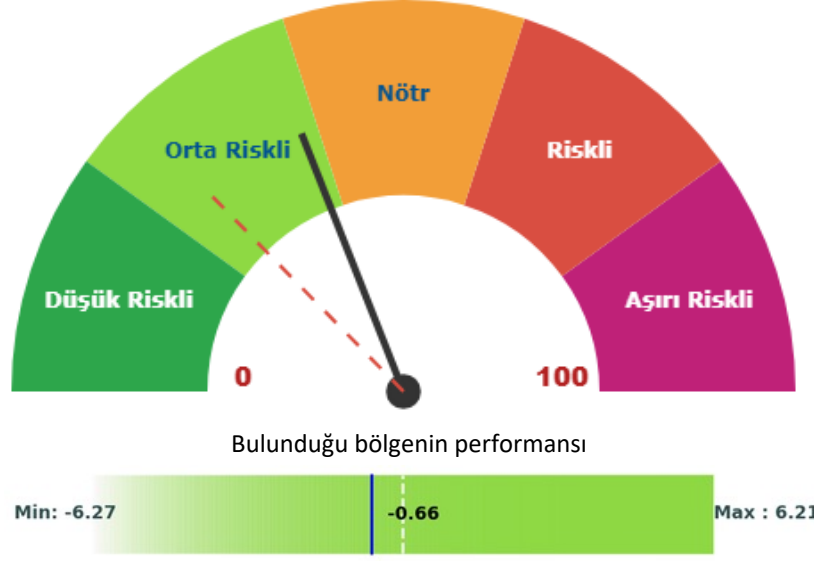
RİSKOMETRE

GÜMÜŞ

25 - 31 Ağustos 2025

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

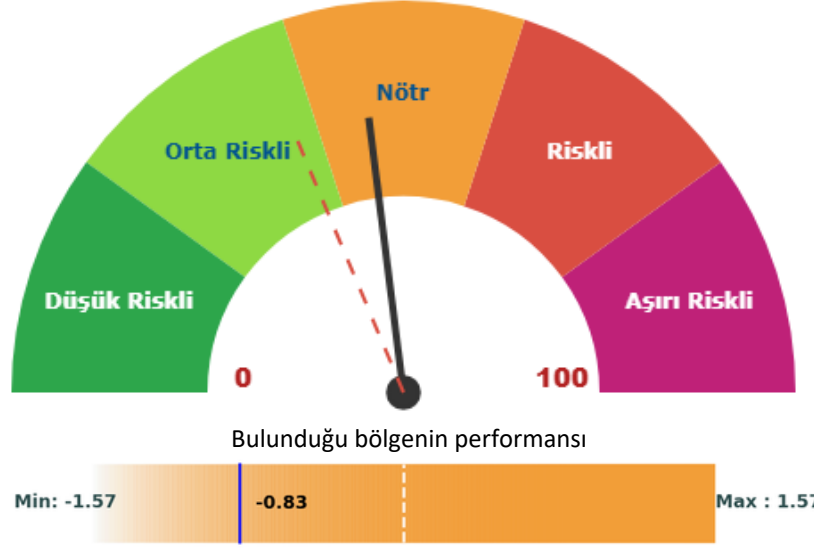
Modelin riskli yöne ilerlediği 1 ayda Gümüş fiyatları **yaklaşık %3.1 değer kaybetmiştir**. Gümüşün getiri performansı orta riskli bölgedeki **tarihsel ortalamasının altındadır**.



GBPUSD

Geçtiğimiz hafta orta riskli bölgeyi test eden GBPUSD modeli bu hafta **nötr bölgeye** dönüş yapmıştır.

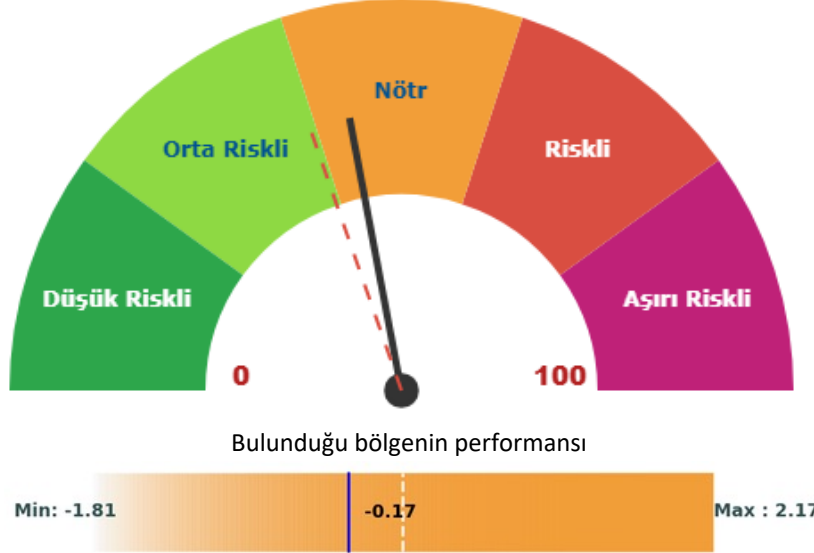
Modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftada parite yaklaşık **%1 değer kaybetmiştir**. GBPUSD parite getirisi model nötr bölgeye girdiğinden beri bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında yer almaktadır**.



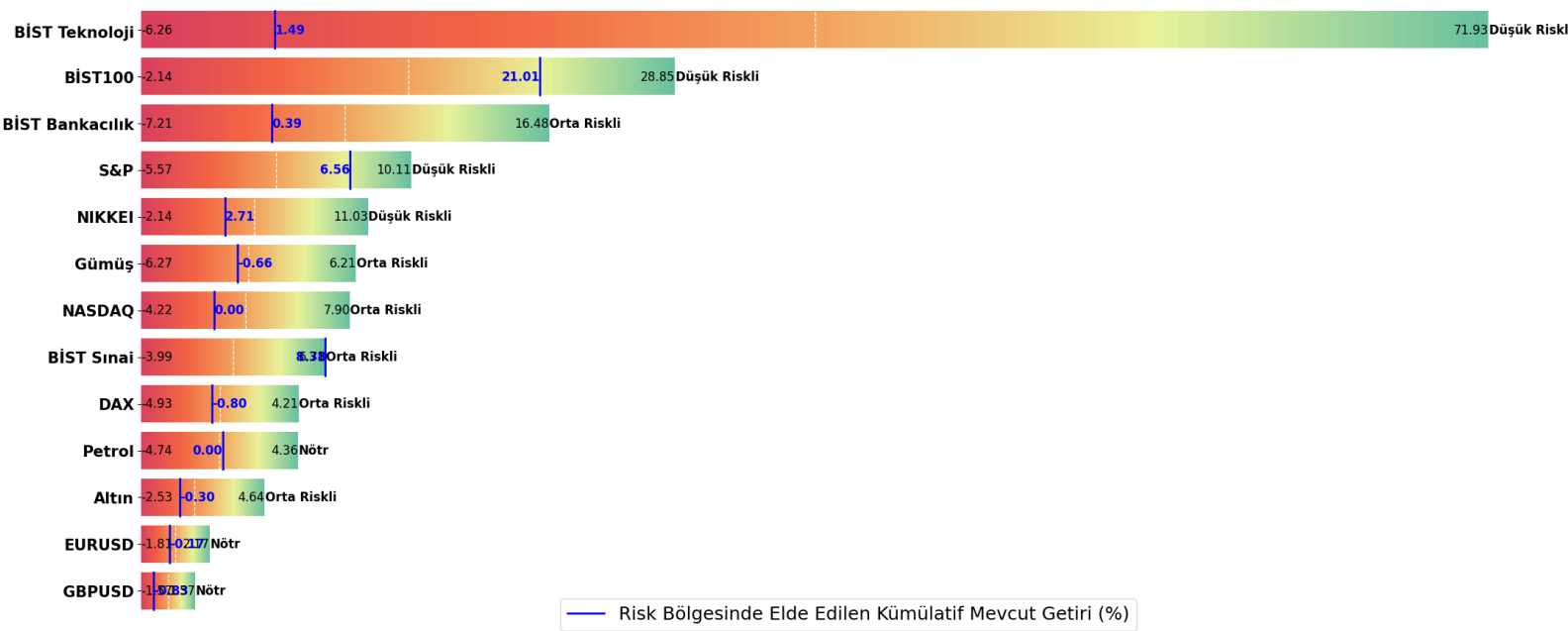
EURUSD

EURUSD modeli bu hafta orta riskli bölgeden **nötr bölgeye** geçiş yapmıştır.

Modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftada EURUSD paritesi yaklaşık **%0.9 değer kaybetmiştir**. EURUSD parite getirisi modelin bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında bulunmaktadır**.

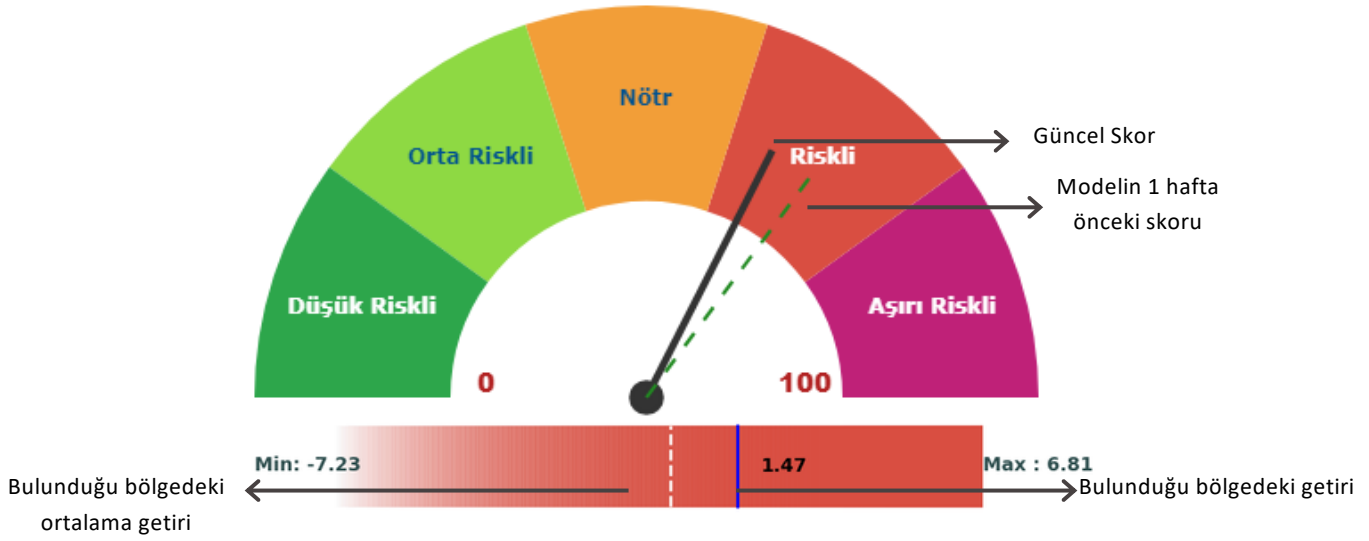


Bulunduğu Bölgeye Göre Getiri Bantları



*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.”