

RİSKOMETRE

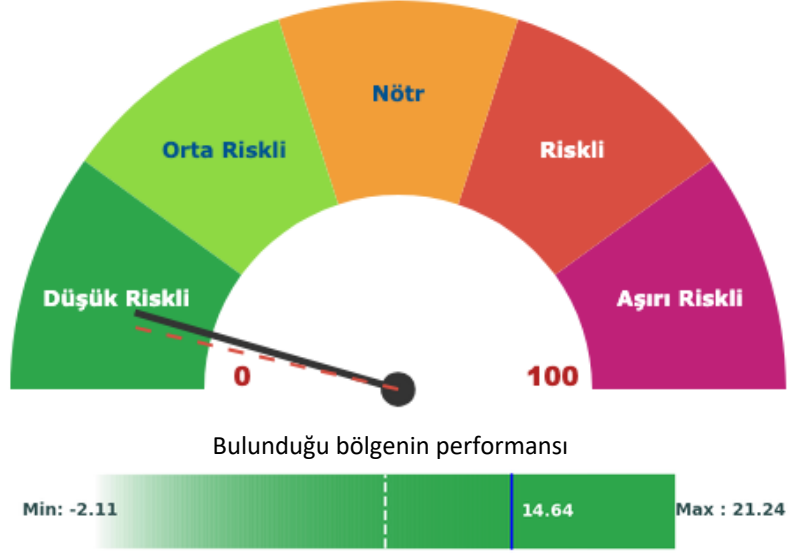
BIST100

4 - 10 Ağustos 2025

BIST100 modeli 1 aylık dönemde **düşük riskli bölgede** riskli yönde ilerlemiştir.

Modelin riskli yönde ilerlemesine rağmen 1 haftada endeks yaklaşık **%0.9 değer kazanmıştır**. Model düşük riskli bölgeye girdiğinden beri BIST100 Endeksi performansı, bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır**.

Bu hafta **9** Bir hafta önce **7** Bir ay önce **1**



BIST TEKNOLOJİ

1 aylık dönemde riskli yönde ilerleyen BİST Teknoloji Modeli **düşük riskli bölgede** bulunmaya devam etmektedir.

Modelin düşük riskli bölgede yer aldığı 1 haftada BİST Teknoloji Endeksi yaklaşık **%0.6 değer kazanmıştır**. BIST Teknoloji Endeksi getiri performansı bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altındadır**.

Bu hafta **13** Bir hafta önce **8** Bir ay önce **1**

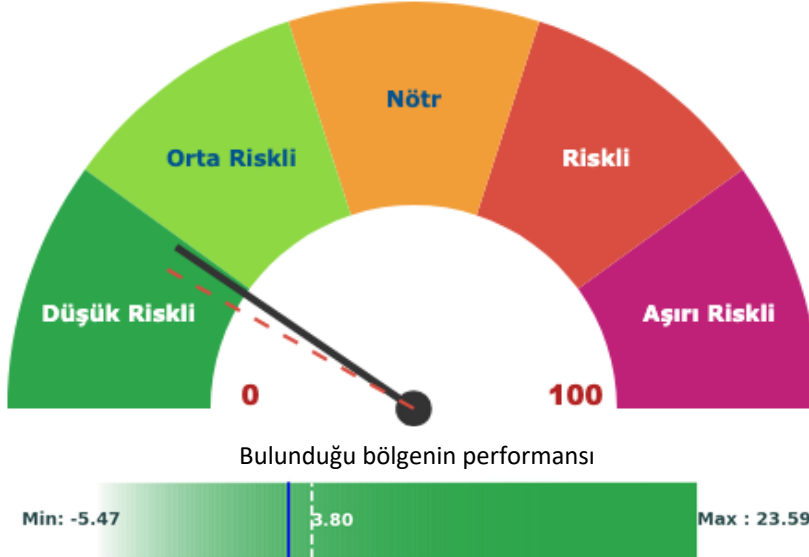


BIST BANKACILIK

Düşük riskli bölgede bulunan BİST Bankacılık modeli 1 aylık dönemde dalgalı seyretmiştir.

BİST Bankacılık Endeksi modelin riskli yöne ilerlediği 1 haftada yaklaşık **%0.2 değer kaybetmiştir**. Model bu bölgeye girdiğinden beri endeksin performansı bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altındadır**.

Bu hafta **19** Bir hafta önce **16** Bir ay önce **20**

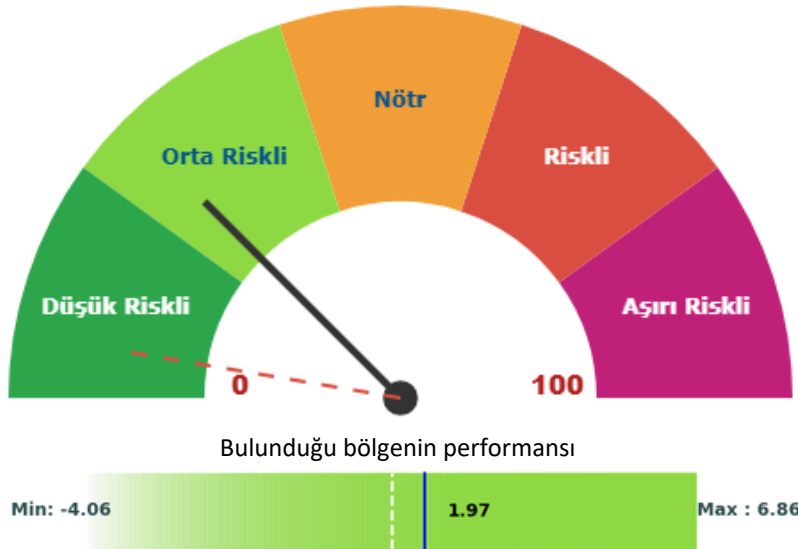


BIST SİNAİ

BIST Sınai modeli 1 haftalık dönemde riskli yönde ilerleyerek **orta riskli bölgeye** geçiş yapmıştır.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda endeks yaklaşık **%9.2 değer kazanmıştır**. Model orta riskli bölgeye girdiğinden beri BIST Sınai Endeksi performansı bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerinde bulunmaktadır**.

Bu hafta **25** Bir hafta önce **5** Bir ay önce **45**



ALTIN

Altın modeli bu hafta riskli yönde ilerleyerek **nötr bölgeye** geçiş yapmıştır.

Modelin riskli yönde ilerlediği 1 haftada Altın fiyatları yaklaşık **%1.4 değer kaybetmiştir**. Model nötr bölgeye girdiğinden beri Altının getirisi bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının üzerindedir**.

Bu hafta **42** Bir hafta önce **36** Bir ay önce **33**



RİSKOMETRE

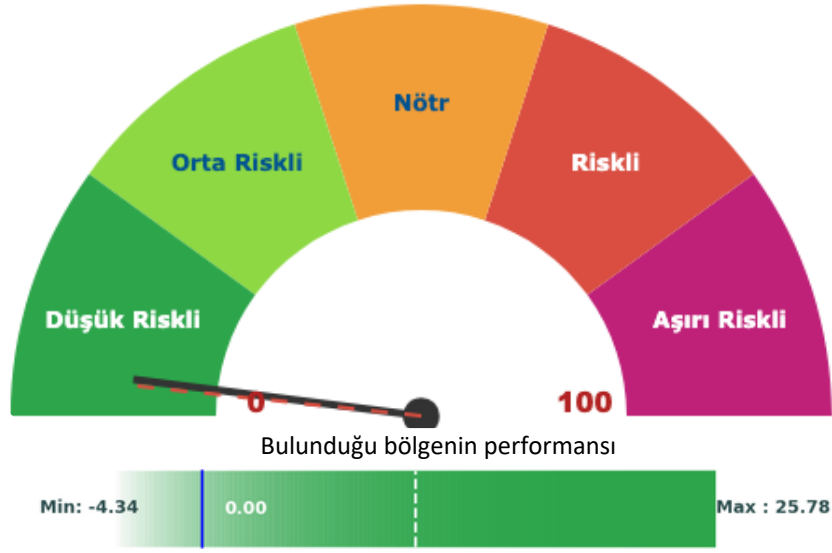
S&P

4 - 10 Ağustos 2025

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

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda endeks yaklaşık **%2.3 değer kazanmıştır**. Endeksin getiri performansı düşük riskli bölgeye girdiğinden beri bu bölgedeki **ortalamasının altında** bulunmaktadır.

Bu hafta 4 Bir hafta önce 3 Bir ay önce 10

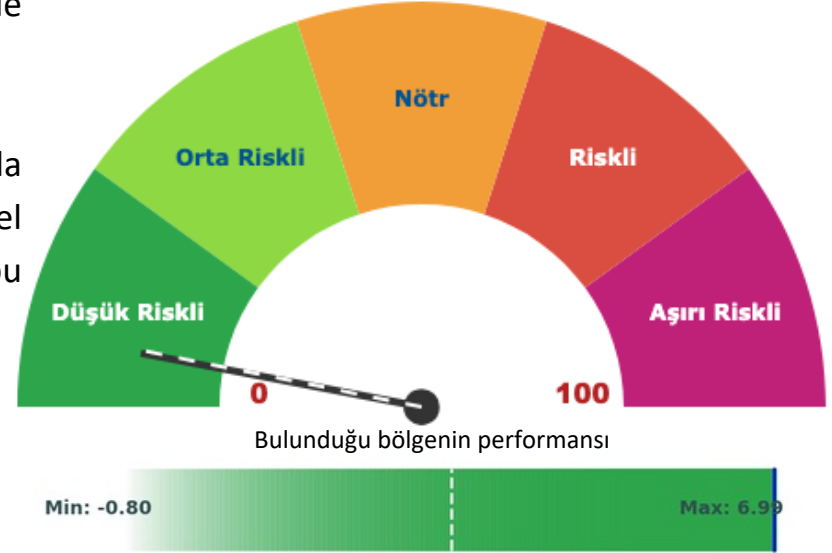


NASDAQ

Nasdaq Modeli 1 aydır **düşük riskli bölge** içinde bulunmaktadır.

Modelin düşük riskli yöne ilerlediği 1 ayda endeks yaklaşık **%2.4 değer kazanmıştır**. Model bu bölgeye girdiğinden beri endeksin getirisi bu bölgedeki **tarihsel maksimum değerindedir**.

Bu hafta 6 Bir hafta önce 6 Bir ay önce 10

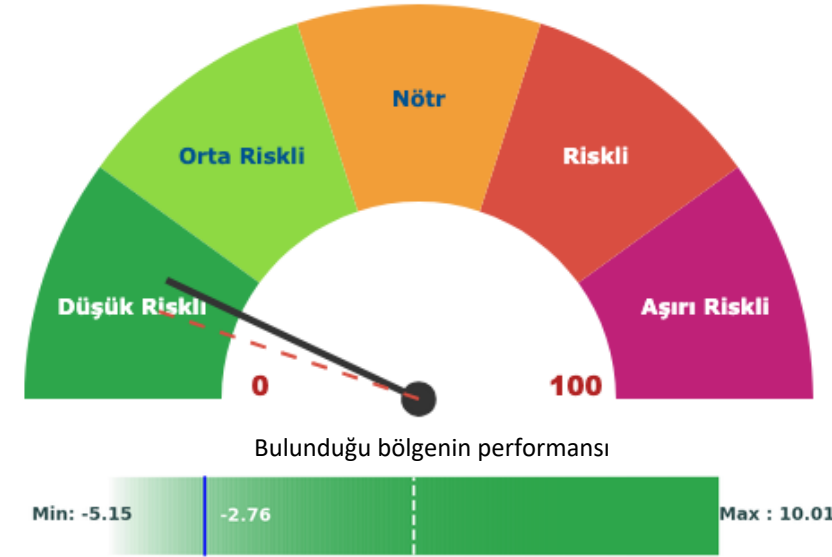


DAX

Düşük riskli bölgede bulunan Almanya hisse senedi modeli 1 aylık dönemde riskli yönde ilerlemiştir.

Modelin riskli yönde ilerlediği 1 ayda DAX Endeksi yaklaşık **%3.9 değer kaybetmiştir**. Model bu bölgeye girdiğinden beri endeksin getiri performansı düşük riskli bölgedeki **tarihsel ortalamasının altındadır**.

Bu hafta 14 Bir hafta önce 10 Bir ay önce 11



NIKKEI

1 aylık dönemde riskli yöne ilerleyen Japonya Hisse Senedi Modeli bu hafta **nötr bölgeye** geçiş yapmıştır.

Modelin riskli yönde ilerlediği 1 haftada endeks yaklaşık **%2.7 değer kaybetmiştir**. Model nötr bölgeye girdiğinden beri Nikkei Endeksi getirisi bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altındadır**.

Bu hafta 48 Bir hafta önce 19 Bir ay önce 2

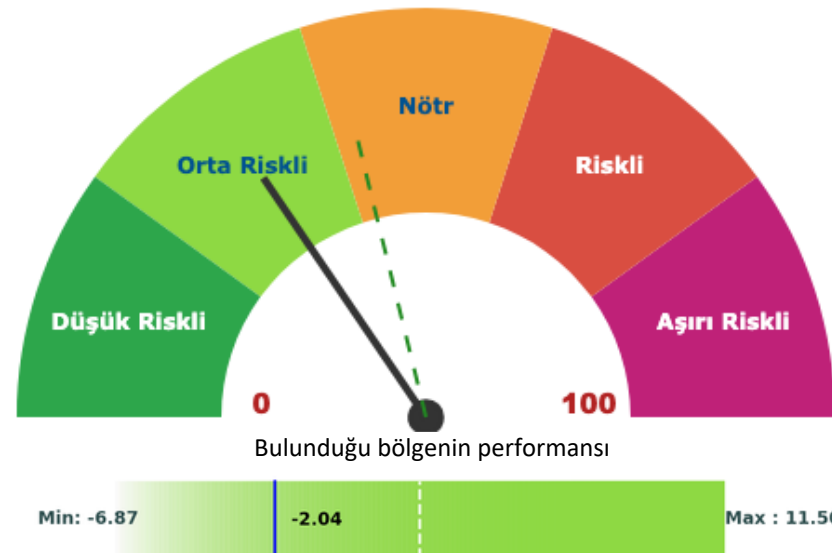


PETROL

1 aylık dönemde dalgalı seyreden Petrol modeli bu hafta **orta riskli bölgeye** dönüş yapmıştır.

Modelin düşük riskli yönde ilerlediği 1 haftada petrol fiyatları **yaklaşık %4.6 değer kazanmıştır**. Model orta riskli bölgeye girdiğinden beri petrolün getirisi bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında** yer almaktadır.

Bu hafta 31 Bir hafta önce 42 Bir ay önce 39



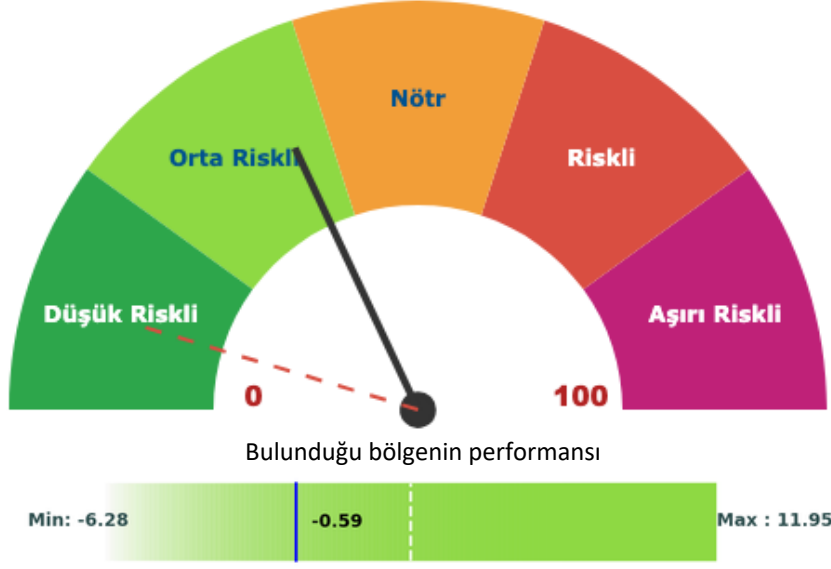
RİSKOMETRE

GÜMÜŞ

4 - 10 Ağustos 2025

Gümüş modeli 1 aylık dönemde dalgalı seyrederken bu hafta **orta riskli** bölgeye geçiş yapmıştır.

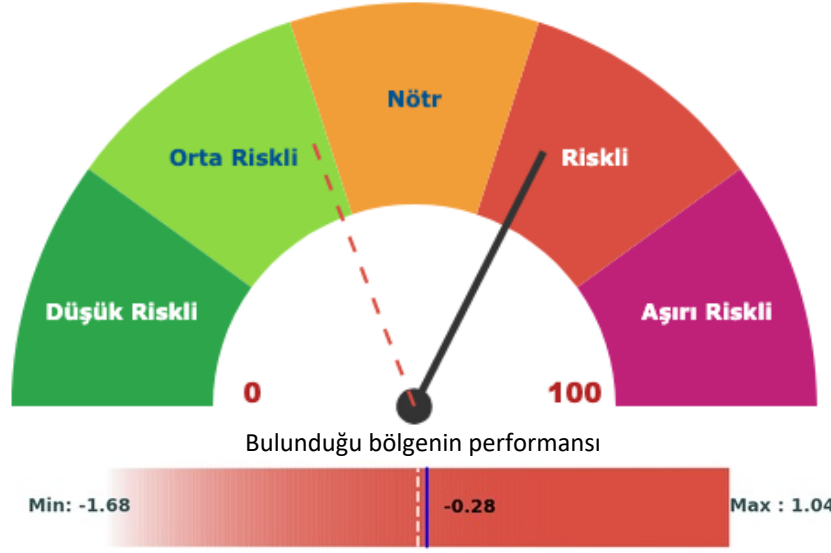
Modelin riskli yönde ilerlediği 1 haftada Gümüş fiyatları yaklaşık **%4.5 değer kaybetmiştir**. Gümüşün getiri performansı orta riskli bölgedeki **tarihsel ortalamasının altındadır**.



GBPUSD

1 aylık dönemde riskli yönde ilerleyen GBPUSD modeli bu hafta **riskli** bölgeye geçmiştir.

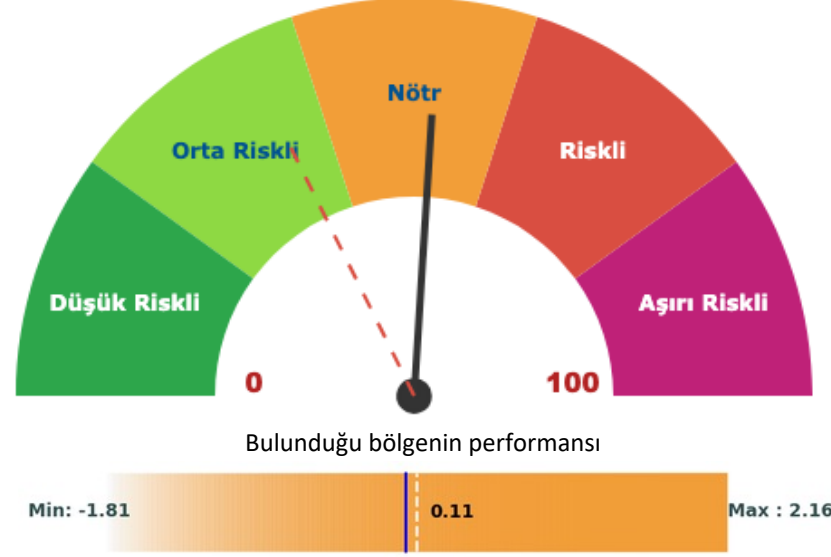
Modelin riskli yönde ilerlediği 1 ayda parite yaklaşık **%2 değer kaybetmiştir**. GBPUSD parite getirisi riskli bölgeye girdiğinden beri bu bölgedeki **tarihsel ortalamasının hafif üzerinde yer almaktadır**.



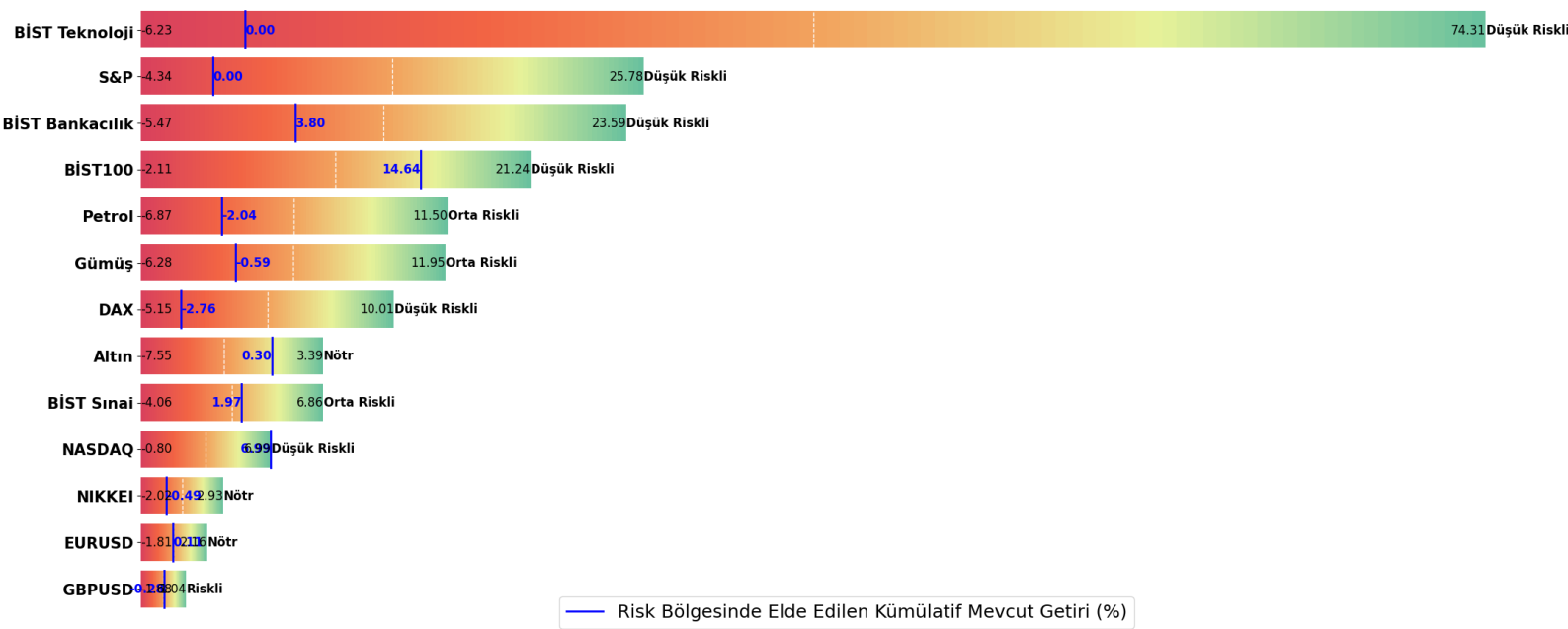
EURUSD

1 aylık dönemde riskli yöne ilerleyen EURUSD bu hafta **nötr bölgeye** geçiş yapmıştır.

Modelin riskli yönde ilerlediği 1 ayda EURUSD paritesi yaklaşık **%3.3 değer kaybetmiştir**. EURUSD parite performansı riskli bölgedeki **tarihsel ortalamasının altında bulunmaktadır**.

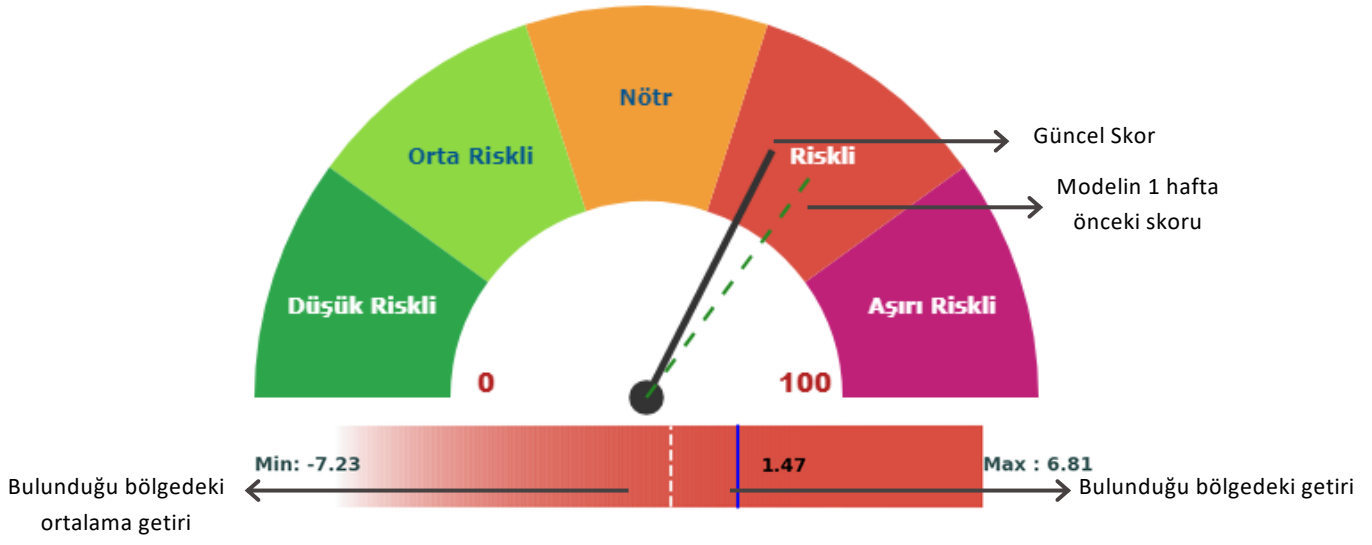


Bulunduğu Bölgeye Göre Getiri Bantları



*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.”