



ITS Shariah индексі (индекс валютасы – АҚШ доллары)

ИНДЕКС ТУРАЛЫ | 09-12-2025

ITS Shariah индексі

ITS Shariah индексі ITS-те сатылатын және Шариғат талаптарына сәйкес келетін капиталдандыру бойынша өлшенетін отыз компания акцияларының өнімділігін көрсетеді. Акциялардың Шариғат талаптарына сәйкестігі Астана халықаралық қаржы орталығының (АХҚО) лицензиясын алған Sahih Systems компаниясының бөлімшесі болып табылатын Sahih Invest компаниясымен тексеріледі. Акцияны іріктеу әдістемесі AAOIFI стандарттарына сәйкес келеді және Татарстан Республикасы Мұсылмандары Діни Басқармасының Ғұламалар Кеңесімен аккредиттелген.

ДИНАМИКА

ИНДЕКСТІҢ ЖИНАҚТАЛҒАН ДИНАМИКАСЫ - ТАЗА ТАБЫС (АҚШ ДОЛЛАРЫ)



ИНДЕКС	ЖЫЛ БАСЫНАН БЕРІ	2024	2023	2022	БАРЛЫҚ МЕРЗІМГЕ
ITS SHARIAH	25,48%	18,01%	18,12%	-17,89%	166,90%
S&P 500 Shariah	17,89%	24,60%	31,60%	-23,48%	155,32%
FTSE Shariah All-World	20,19%	8,78%	23,17%	-18,85%	112,51%
АЛТЫН	61,07%	27,48%	13,34%	-0,43%	151,44%



Its Shariah индексі 2023 жылдың 10 тамызында іске қосылды. Осы күнге дейінгі деректер индекстің нақты динамикасына емес, гипотетикалық бәж-тесттерге негізделген (яғни, егер индекс бұрыннан бері бар болса, осы уақыт аралығында өзін қалай көрсете алатынын есептеу). Бұл деректер индекстің іске қосылған күнгі әдіснамасына негізделген. 2023 жылғы 6 маусымда ITS алаңында сауда басталғаннан кейін индекс әдіснамасының ережелері жеткілікті бағалы қағаздарды қамту үшін, мақсатты нарық динамикасын модельдеу үшін жеңілдетілді және оны индекске өлшеу жоспарланған. Мысалы, бағалы қағаздар саны, нарықтық капиталдандыру және өтімділік деңгейлері төмендеуі мүмкін. Көбінесе бәж-тесттердегі және нақты өмірдегі индекстің динамикасы әр түрлі болады, сондықтан нақты кірістілік тест нәтижелерінен төмен болуы мүмкін. Алдыңғы кезеңдегі динамика - нақтысы да, бәж-тесттағы да – болашақ динамиканың көрсеткіші немесе көпшілігі емес. Индекс туралы қосымша ақпарат алу үшін, оның қайта теңдестіру әдістері мен уақытын, акцияларды қосу және жою критерийлерін, есеп айырысу әдістері мен корпоративтік іс-қимыл саясатын қоса алғанда білу үшін www.its.kz сайтындағы индекс әдістемесін қараңыз. Динамикалық бәж-тест нәтижелері жеке инвесторларға емес, тек институционалды пайдалануға арналған.



ШАРП КОЭФФИЦИЕНТІ

Шарп коэффициенті инвестициялық индекстің өз тәуекеліне түзетуді ескере отырып, тәуекелсіз активпен (АҚШ-тың 3 айлық қазынашылық вексельдері) салыстырғанда, 5 жылдық кезеңдегі тиімділігін өлшейді.

ИНДЕКС	ШАРП КОЭФФИЦИЕНТІ
ITS Shariah	0,69
S&P 500 Shariah	0,72
FTSE Shariah All-World	0,47
Алтын	1,01

МАКСИМАЛДЫ ТҮСУ

Максималды түсу – бұл портфель құнының максималды мәннен минималды мәнге дейінгі ең үлкен шығыны. Максималды түсу мәні жаңа максимумға жеткенше сақталады.



КЕЗЕҢ	ITS Shariah	S&P 500 Shariah	FTSE Shariah All-World	Алтын
1 жыл	24,80%	28,23%	26,41%	20,43%
1 ай	16,21%	14,83%	13,91%	8,96%



Its Shariah индексі 2023 жылдың 10 тамызында іске қосылды. Осы күнге дейінгі деректер индекстің нақты динамикасына емес, гипотетикалық бәз-тесттерге негізделген (яғни, егер индекс бұрыннан бері бар болса, осы уақыт аралығында өзін қалай көрсете алатынын есептеу). Бұл деректер индекстің іске қосылған күнгі әдіснамасына негізделген. 2023 жылғы 6 маусымда ITS алаңында сауда басталғаннан кейін индекс әдіснамасының ережелері жеткілікті бағалы қағаздарды қамту үшін, мақсатты нарық динамикасын модельдеу үшін жеңілдетілген және оны индекспен өлшеу жоспарланған. Мысалы, бағалы қағаздар саны, нарықтық капиталдағы және өтімділік деңгейлері төмендеуі мүмкін. Көбінесе бәз-тесттердегі және нақты өмірдегі индекстің динамикасы әр түрлі болады, сондықтан нақты кірістілік тест нәтижелерінен төмен болуы мүмкін. Алдыңғы кезеңдегі динамика - нақтысы да, бәз-тесттағы да – болашақ динамиканың көрсеткіші немесе көпілі емес. Индекс туралы қосымша ақпарат алу үшін, оның қайта теңдестіру әдістері мен уақытын, акцияларды қосу және жою критерийлерін, есеп айырысу әдістері мен корпоративтік іс-қимыл саясатын қоса алғанда білу үшін www.its.kz сайтындағы индекс әдістемесін қараңыз. Динамикалық бәз-тест нәтижелері жеке инвесторларға емес, тек институционалды пайдалануға арналған.



КОМПОНЕНТТЕР

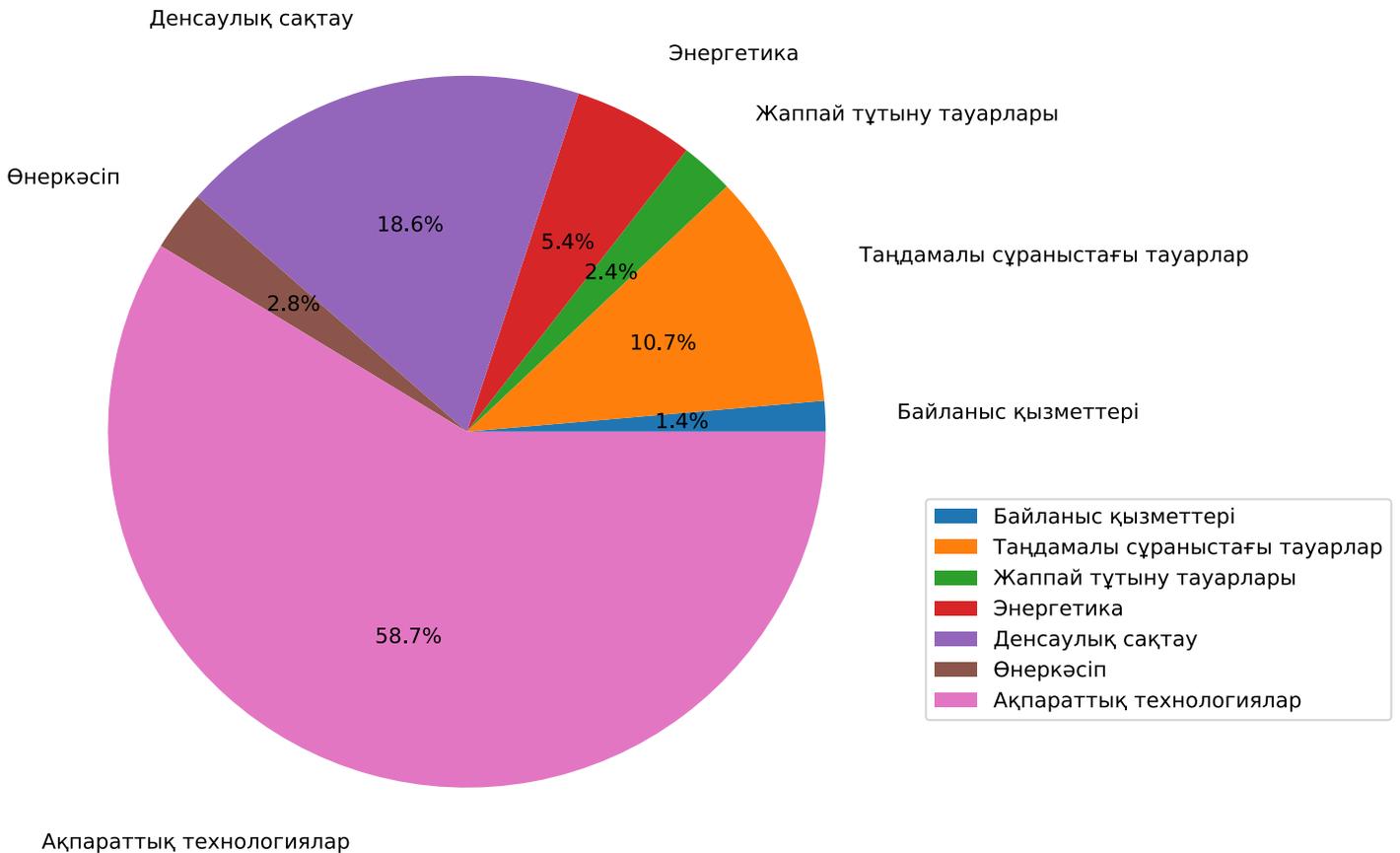
ITS Shariah индексінің бір компонентке шаққанда шоғырлану шегі 10% құрайды. Егер индекстің бір немесе бірнеше компонентінің салмағы (немесе бір эмитентке тиесілі индекс компоненттерінің барлық салмағының қосындысы) қайта теңгерім болған күні 10% асса, артық көлем мәні индекстің басқа компоненттеріне пропорционалды түрде бөлінеді.

СОҒҒЫ ҚАЙТА ТЕҢГЕРІМДЕУ КҮНІНДЕГІ ИНДЕКС КОМПОНЕНТТЕРІ

1	AAPL	APPLE INC.	10,00%
2	AVGO	BROADCOM INC.	10,00%
3	MSFT	MICROSOFT CORPORATION	10,00%
4	NVDA	NVIDIA CORPORATION	10,00%
5	TSLA	TESLA, INC.	9,57%
6	LLY	ELI LILLY AND COMPANY	5,31%
7	ORCL	ORACLE CORPORATION	5,14%
8	XOM	EXXON MOBIL CORPORATION	3,32%
9	JNJ	JOHNSON & JOHNSON	3,11%
10	ABBV	ABBVIE INC.	2,71%
11	PG	THE PROCTER & GAMBLE COMPANY	2,41%
12	AMD	ADVANCED MICRO DEVICES, INC.	2,31%
13	CVX	CHEVRON CORPORATION	2,12%
14	CSCO	CISCO SYSTEMS, INC.	1,92%
15	AZN	ASTRAZENECA PLC	1,78%
16	CAT	CATERPILLAR INC.	1,65%
17	CRM	SALESFORCE, INC.	1,59%
18	ABT	ABBOTT LABORATORIES	1,54%
19	MU	MICRON TECHNOLOGY, INC.	1,52%
20	MRK	MERCK & CO., INC.	1,50%
21	APP	APPLOVIN CORPORATION CLASS A	1,39%
22	TMO	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC.	1,38%
23	UBER	UBER TECHNOLOGIES, INC.	1,33%
24	NOW	SERVICENOW, INC.	1,27%
25	QCOM	QUALCOMM INCORPORATED	1,24%
26	ISRG	INTUITIVE SURGICAL, INC.	1,22%
27	LRCX	LAM RESEARCH CORPORATION	1,22%
28	ANET	ARISTA NETWORKS, INC.	1,21%
29	BKNG	BOOKING HOLDINGS INC.	1,15%
30	GEV	GE VERNOVA INC.	1,11%



СЕКТОРЛАР БОЙЫНША ӨЛШЕМДЕР



ШАРИҒАТ БОЙЫНША ІРІКТЕУ (ТЕКСЕРУ) ӘДІСТЕМЕСІ

Индекс құрамы AAOIFI белгілеген критерийлер негізінде Тәуелсіз Сарапшының әдістемесімен анықталған Шариғат стандарттарына сәйкес келетін нарықтық капиталдандырудың ең ірі компоненттерінен тұрады.

ITS Shariah Индексінің барлық компоненттері екі санат бойынша Шариғатқа сәйкестік скринингінен өтеді: қызмет бойынша (компанияның жұмысы Шариғат талаптарына сәйкес келуі) және бухгалтерлік есеп бойынша (қаржылық коэффициенттердің белгіленген шектерге сәйкес келуі).

2024 жылдың 4 қыркүйегінде индекс компоненттерін таңдау әдістемесінің жаңартылуына байланысты индекс құрамы өзгертулерге ұшырады. Бұл жаңарту активтердің жалпы көлемінің орнына 24 айдағы орташа нарықтық капиталдандыруды пайдалануды көздейді.