ITS Shariah индексі
(индекс валютасы – АҚШ доллары)

ИНДЕКС ТУРАЛЫ | 09-06-2025

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	**0,52%**	**18,01%**	**18,12%**	**-17,89%**	**113,82%**
S&P 500 Shariah	-0,14%	24,60%	31,60%	-23,48%	116,28%
FTSE Shariah All-World	2,85%	8,78%	23,17%	-18,85%	81,86%
Алтын	26,73%	27,48%	13,34%	-0,43%	97,84%

Its Sharjah индексі 2023 жылдың 10 тамызында іске қосылды. Осы күнге дейінгі деректер индекстің нақты динамикасына емес, гипотетикалық бэк-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 жеңілдетіледі және оны индекспен өлшеу жоспарланған.Мысалы, бағалы қағаздар саны, нарықтық капиталдандыру және өтімділік деңгейлері төмендеуі мүмкін. Көбінесе бэк-тесттердегі және нақты өмірдегі индекстің динамикасы әр түрлі болады, сондықтан нақты кірістілік тест нәтижелерінен төмен болуы мүмкін. Алдыңғы кезеңдегі динамика - нақтысы да, бэк-тесттағы да – болашақ динамиканың көрсеткіші немесе кепілі 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.itsx.kz сайтындағы индекс әдістемесін қараңыз. Динамикалық бэк-тест нәтижелері жекелей инвесторларға емес, тек институционалды пайдалануға арналған.

Sahih Invest

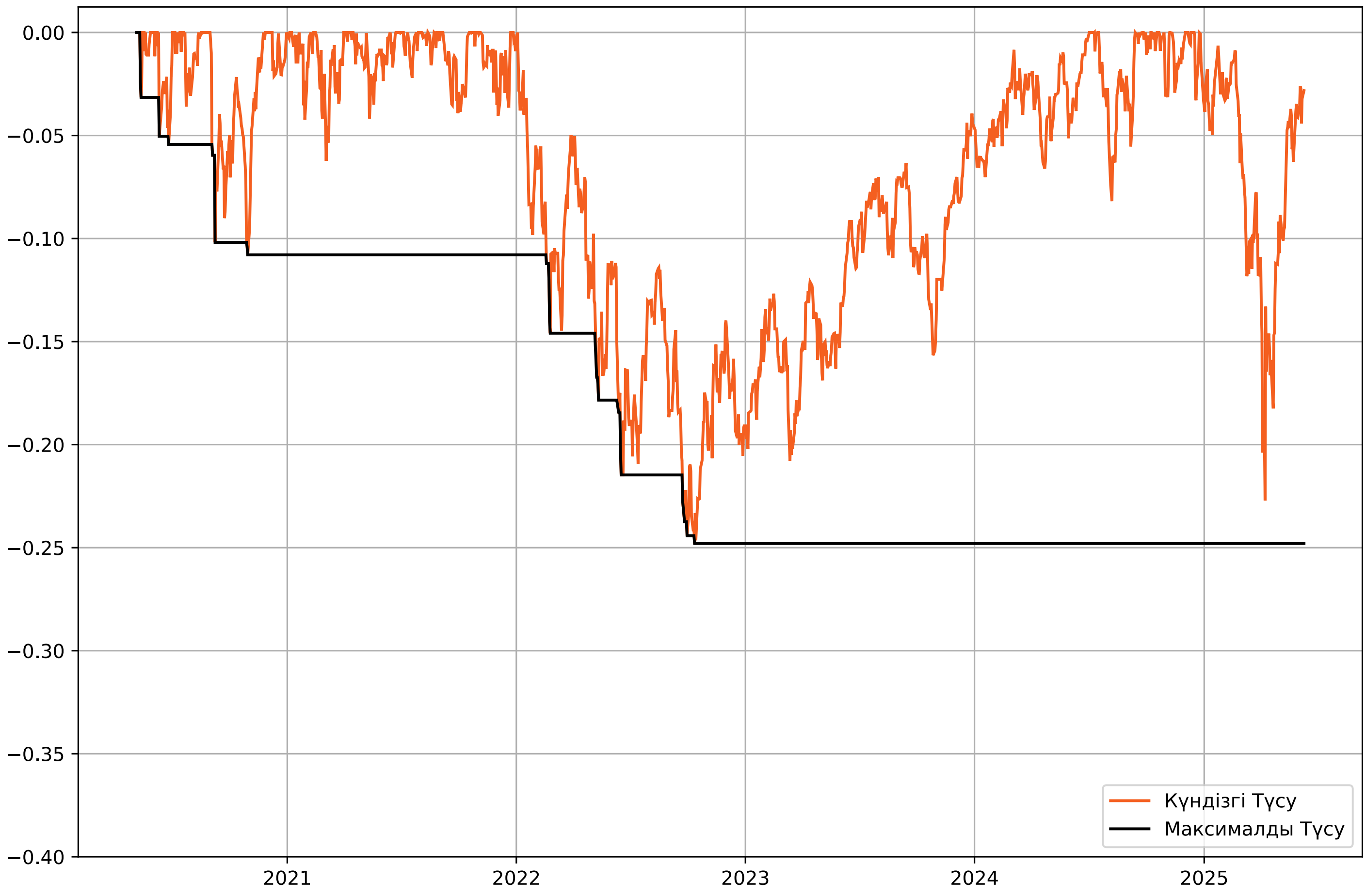
ШАРП КОЭФФИЦИЕНТІ

Шарп коэффициенті индекстің өз тәуекеліне түзетуді ескере отырып, тәуекелсіз активке (АҚШ-тың 3 айлық қазынашылық вексельдері) салынған инвестициялармен салыстырғанда 2020 жылдың мамыр айынан бастап индекске салынған инвестициялардың тиімділігін өлшейді.

ИНДЕКС	ШАРП КОЭФФИЦИЕНТІ
ITS Shariah	**0,68**
S&P 500 Shariah	0,73
FTSE Shariah All-World	0,57
Алтын	0,78

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%	8,95%

Its Sharjah индексі 2023 жылдың 10 тамызында іске қосылды. Осы күнге дейінгі деректер индекстің нақты динамикасына емес, гипотетикалық бэк-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 жеңілдетіледі және оны индекспен өлшеу жоспарланған.Мысалы, бағалы қағаздар саны, нарықтық капиталдандыру және өтімділік деңгейлері төмендеуі мүмкін. Көбінесе бэк-тесттердегі және нақты өмірдегі индекстің динамикасы әр түрлі болады, сондықтан нақты кірістілік тест нәтижелерінен төмен болуы мүмкін. Алдыңғы кезеңдегі динамика - нақтысы да, бэк-тесттағы да – болашақ динамиканың көрсеткіші немесе кепілі 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.itsx.kz сайтындағы индекс әдістемесін қараңыз. Динамикалық бэк-тест нәтижелері жекелей инвесторларға емес, тек институционалды пайдалануға арналған.

КОМПОНЕНТТЕР

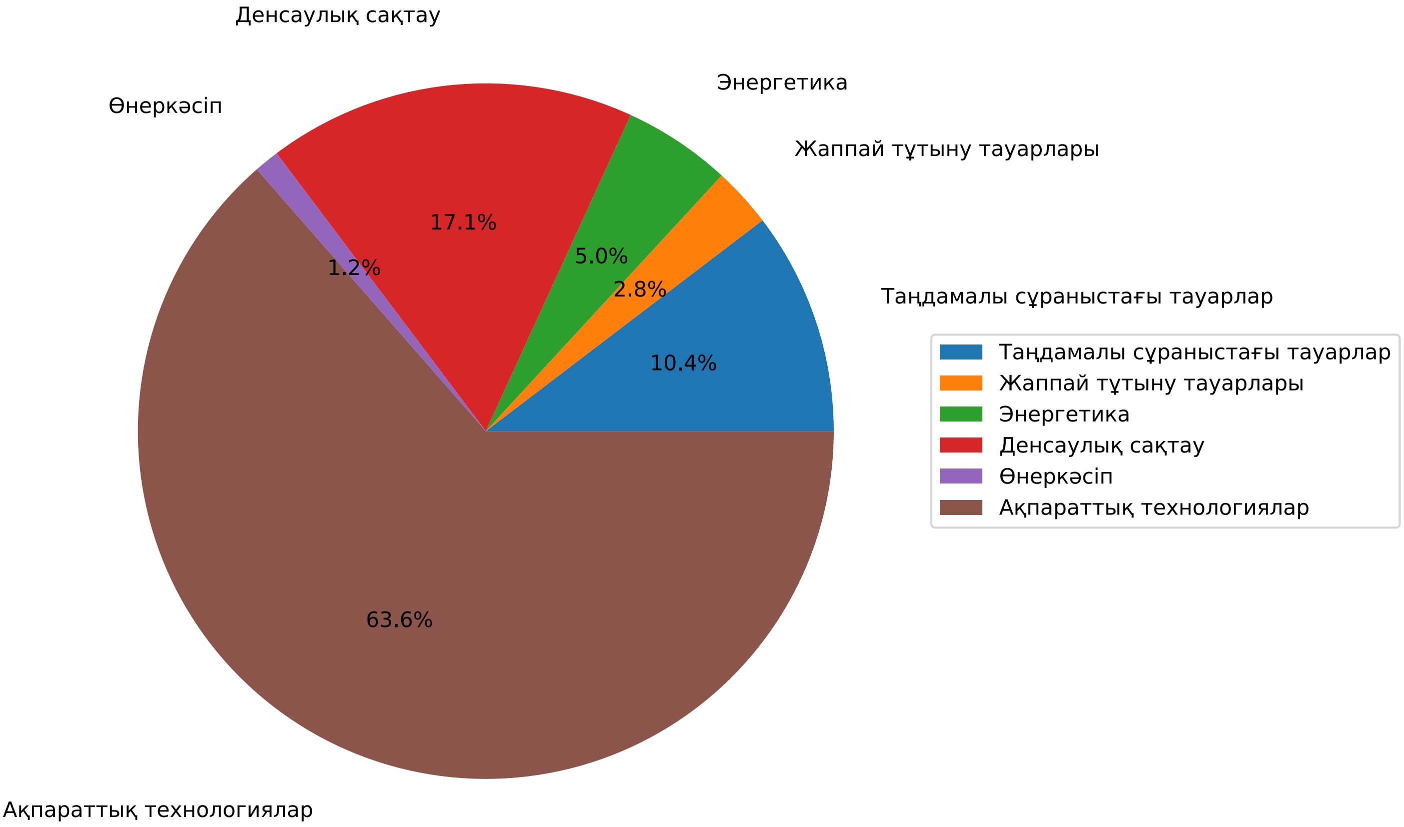
ITS Shariah индексінің бір компонентке шаққанда шоғырлану шегі 10% құрайды. Егер индекстің бір немесе бірнеше компонентінің салмағы (немесе бір эмитентке тиесілі индекс компоненттерінің барлық салмағының қосындысы) қайта теңгерім болған күні 10% асса, артық көлем мәні индекстің басқа компоненттеріне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

СОҢҒЫ ҚАЙТА ТЕҢГЕРІМДЕУ КҮНІНДЕГІ ИНДЕКС КОМПОНЕНТТЕРІ

1	**AAPL**	APPLE INC.	**10,00%**
2	**MSFT**	MICROSOFT CORPORATION	**10,00%**
3	**NVDA**	NVIDIA CORPORATION	**10,00%**
4	**AVGO**	BROADCOM INC.	**7,78%**
5	**TSLA**	TESLA, INC.	**7,70%**
6	**TSM**	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LTD.	**7,13%**
7	**LLY**	ELI LILLY AND COMPANY	**4,84%**
8	**XOM**	EXXON MOBIL CORPORATION	**3,28%**
9	**ORCL**	ORACLE CORPORATION	**3,22%**
10	**PG**	THE PROCTER & GAMBLE COMPANY	**2,78%**
11	**JNJ**	JOHNSON & JOHNSON	**2,67%**
12	**HD**	THE HOME DEPOT, INC.	**2,66%**
13	**SAP**	SAP SE (ADR)	**2,54%**
14	**ABBV**	ABBVIE INC.	**2,37%**
15	**CRM**	SALESFORCE, INC.	**1,94%**
16	**CSCO**	CISCO SYSTEMS, INC.	**1,80%**
17	**CVX**	CHEVRON CORPORATION	**1,74%**
18	**ABT**	ABBOTT LABORATORIES	**1,67%**
19	**AZN**	ASTRAZENECA PLC	**1,59%**
20	**NOW**	SERVICENOW, INC.	**1,52%**
21	**ISRG**	INTUITIVE SURGICAL, INC.	**1,43%**
22	**MRK**	MERCK & CO., INC.	**1,41%**
23	**INTU**	INTUIT INC.	**1,40%**
24	**UBER**	UBER TECHNOLOGIES, INC.	**1,32%**
25	**AMD**	ADVANCED MICRO DEVICES, INC.	**1,30%**
26	**ADBE**	ADOBE INC.	**1,25%**
27	**TXN**	TEXAS INSTRUMENTS INCORPORATED	**1,19%**
28	**QCOM**	QUALCOMM INCORPORATED	**1,18%**
29	**CAT**	CATERPILLAR INC.	**1,17%**
30	**BSX**	BOSTON SCIENTIFIC CORPORATION	**1,12%**

Its Sharjah индексі 2023 жылдың 10 тамызында іске қосылды. Осы күнге дейінгі деректер индекстің нақты динамикасына емес, гипотетикалық бэк-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 жеңілдетіледі және оны индекспен өлшеу жоспарланған.Мысалы, бағалы қағаздар саны, нарықтық капиталдандыру және өтімділік деңгейлері төмендеуі мүмкін. Көбінесе бэк-тесттердегі және нақты өмірдегі индекстің динамикасы әр түрлі болады, сондықтан нақты кірістілік тест нәтижелерінен төмен болуы мүмкін. Алдыңғы кезеңдегі динамика - нақтысы да, бэк-тесттағы да – болашақ динамиканың көрсеткіші немесе кепілі 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.itsx.kz сайтындағы индекс әдістемесін қараңыз. Динамикалық бэк-тест нәтижелері жекелей инвесторларға емес, тек институционалды пайдалануға арналған.

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.

Its Sharjah индексі 2023 жылдың 10 тамызында іске қосылды. Осы күнге дейінгі деректер индекстің нақты динамикасына емес, гипотетикалық бэк-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 жеңілдетіледі және оны индекспен өлшеу жоспарланған.Мысалы, бағалы қағаздар саны, нарықтық капиталдандыру және өтімділік деңгейлері төмендеуі мүмкін. Көбінесе бэк-тесттердегі және нақты өмірдегі индекстің динамикасы әр түрлі болады, сондықтан нақты кірістілік тест нәтижелерінен төмен болуы мүмкін. Алдыңғы кезеңдегі динамика - нақтысы да, бэк-тесттағы да – болашақ динамиканың көрсеткіші немесе кепілі 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.itsx.kz сайтындағы индекс әдістемесін қараңыз. Динамикалық бэк-тест нәтижелері жекелей инвесторларға емес, тек институционалды пайдалануға арналған.