



ITS Shariah индексі (индекс валютасы – АҚШ доллары)

ИНДЕКС ТУРАЛЫ | 10-03-2025

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	2022	2023	2024	БАРЛЫҚ МЕРЗІМГЕ
ITS SHARIAH	-8,80%	-17,89%	18,12%	18,01%	94,00%
S&P 500 Shariah	-6,88%	-23,48%	31,60%	24,60%	101,69%
FTSE Shariah All-World	-2,06%	-18,85%	23,17%	8,78%	73,17%
АЛТЫН	9,96%	-0,43%	13,34%	27,48%	71,65%



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 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

ITS Shariah

ШАРП КОЭФФИЦИЕНТІ

0,72

S&P 500 Shariah

0,80

FTSE Shariah All-World

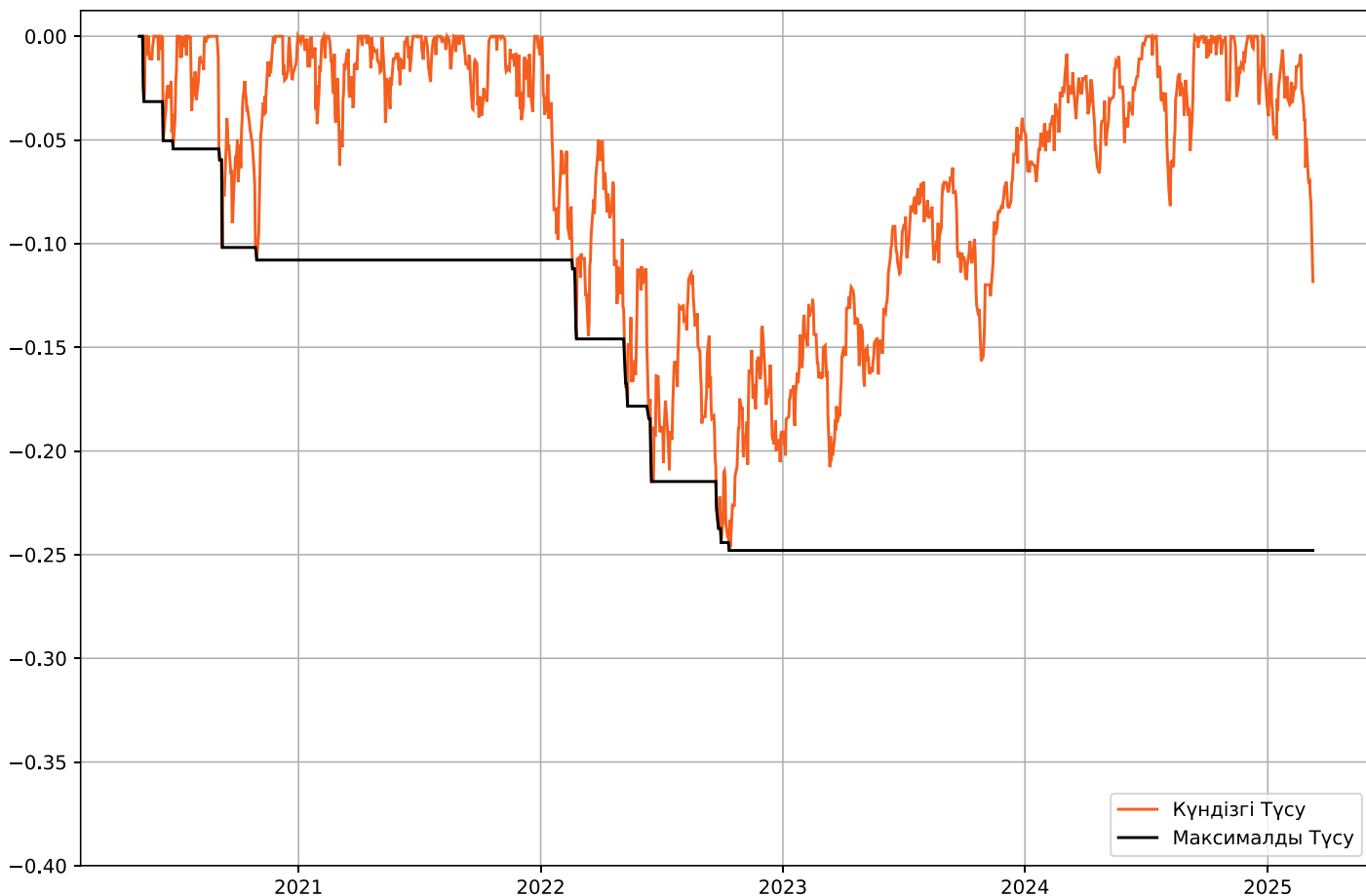
0,60

Алтын

0,63

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	11,68%	12,87%	12,12%	8,95%



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 жетілдіріліп бағалы қағаздарды қамту үшін, мақсатты нарық динамикасын модельдеу үшін жеңілдетілген және оны индекспен өлшеу жоспарланған. Мысалы, бағалы қағаздар саны, нарықтық капиталдаңдыру 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 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.its.kz сайтындағы индекс әдістемесін қараңыз. Динамикалық бәж-тест нәтижелері жеке инвесторларға емес, тек институционалды пайдалануға арналған.



КОМПОНЕНТТЕР

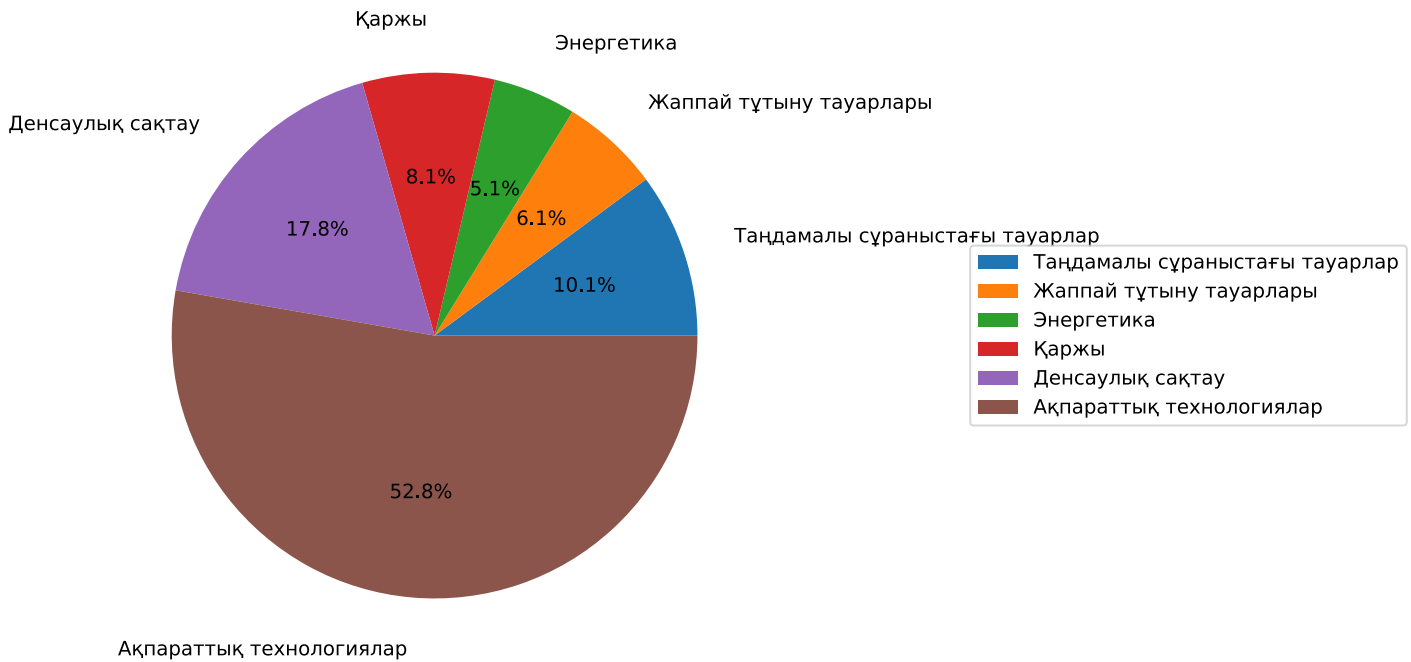
ITS Shariah индексінің бір компонентке шаққанда шоғырлану шегі 10% құрайды. Егер индекстің бір немесе бірнеше компонентінің салмағы (немесе бір эмитентке тиесілі индекс компоненттерінің барлық салмағының қосындысы) қайта теңгерім болған күні 10% асса, артық көлем мәні индекстің басқа компоненттеріне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

СОҒҒЫ ҚАЙТА ТЕҢГЕРІМДЕУ КҮНІНДЕГІ ИНДЕКС КОМПОНЕНТТЕРІ

1	AAPL	APPLE INC.	10,00%
2	MSFT	MICROSOFT CORPORATION	10,00%
3	NVDA	NVIDIA CORPORATION	10,00%
4	TSLA	TESLA, INC.	7,41%
5	AVGO	BROADCOM INC.	7,08%
6	LLY	ELI LILLY AND COMPANY	5,36%
7	V	VISA INC.	4,62%
8	MA	MASTERCARD INCORPORATED CLASS A	3,50%
9	ORCL	ORACLE CORPORATION	3,27%
10	XOM	EXXON MOBIL CORPORATION	3,25%
11	HD	THE HOME DEPOT, INC.	2,71%
12	PG	THE PROCTER & GAMBLE COMPANY	2,70%
13	JNJ	JOHNSON & JOHNSON	2,60%
14	ABBV	ABBVIE INC.	2,37%
15	SAP	SAP SE (ADR)	2,28%
16	CRM	SALESFORCE, INC.	2,08%
17	KO	THE COCA-COLA COMPANY	2,00%
18	CVX	CHEVRON CORPORATION	1,86%
19	CSCO	CISCO SYSTEMS, INC.	1,72%
20	ABT	ABBOTT LABORATORIES	1,57%
21	AZN	ASTRAZENECA PLC	1,56%
22	MRK	MERCK & CO., INC.	1,51%
23	ISRG	INTUITIVE SURGICAL, INC.	1,43%
24	TMO	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC.	1,41%
25	PEP	PEPSICO, INC.	1,38%
26	NOW	SERVICENOW, INC.	1,37%
27	ADBE	ADOBE INC.	1,33%
28	QCOM	QUALCOMM INCORPORATED	1,26%
29	AMD	ADVANCED MICRO DEVICES, INC.	1,20%
30	TXN	TEXAS INSTRUMENTS INCORPORATED	1,17%



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.