



# Индекс ITS Shariah (валюта индекса – доллар США)

ОБ ИНДЕКСЕ | 06 фев 2025

## Индекс ITS Shariah

Индекс ITS Shariah отображает динамику тридцати взвешенных по капитализации акций компаний, которые соответствуют требованиям Шариата и обращаются на ITS. Акции, включенные в индекс, прошли тщательную независимую экспертизу лицензированной в МФЦА компании Sahih Invest на соответствие требованиям Шариата. Методология отбора акций соответствует стандартам ААОIFI и аккредитована Советом Улемов Духовного Управления Мусульман Республики Татарстан.

## ДИНАМИКА

### НАКОПЛЕННАЯ ДИНАМИКА ИНДЕКСА – ЧИСТЫЙ ДОХОД (ДОЛЛАР США)



ИНДЕКС	С НАЧАЛА ГОДА	2022	2023	2024	ЗА ВСЕ ВРЕМЯ
<b>ITS SHARIAH</b>	<b>1,16%</b>	<b>-17,89%</b>	<b>18,12%</b>	<b>18,01%</b>	<b>115,17%</b>
S&P 500 Shariah	2,14%	-23,48%	31,60%	24,60%	121,21%
FTSE Shariah All-World	2,72%	-18,85%	23,17%	8,78%	81,62%
Золото	8,63%	-0,43%	13,34%	27,48%	69,58%



Индекс ITS Shariah был запущен 10 августа 2023 года. Данные до этой даты основаны на гипотетических бэк-тестах (т.е. на расчетах того, как индекс мог бы вести себя в течение этого периода времени, если бы он существовал), а не на фактической динамике индекса. Эти данные основаны на методологии индекса, действовавшей на дату его запуска. Поскольку торги на площадке ITS начались только 6 июня 2023 года, правила методологии индекса на периоде бэк-тестирования могли быть несколько смягчены в целях охвата достаточного числа ценных бумаг для моделирования динамики целевого рынка. Например, требования к универсальности, уровню рыночной капитализации и ликвидности могут быть ослаблены. Обычно динамика индекса на бэк-тестах и в ситуации реального расчета различается, поэтому фактическая доходность может быть ниже тестовых результатов. Динамика за предыдущий период - как фактическая, так и на бэк-тестах - не является указанием или гарантией динамики в будущем. Пожалуйста, ознакомьтесь внимательно с методологией на [www.itsx.kz](http://www.itsx.kz) для дополнительной информации об индексе, включая способы и время его ребалансировки, критерии для добавления и удаления акций, методы расчета и политику учета корпоративных действий. Результаты бэк-тестов динамики предназначены для использования только профессиональными участниками рынка ценных бумаг и не предназначены для розничных инвесторов.



### КОЭФФИЦИЕНТ ШАРПА

Коэффициент Шарпа измеряет эффективность инвестиций в индекс за весь период, начиная с 05/2020, по сравнению с инвестициями в безрисковый актив (3-месячные векселя США) с учетом корректировки на риск самого индекса.

### ИНДЕКС

### КОЭФФИЦИЕНТ ШАРПА

**ITS Shariah**

**0,76**

S&P 500 Shariah

0,85

FTSE Shariah All-World

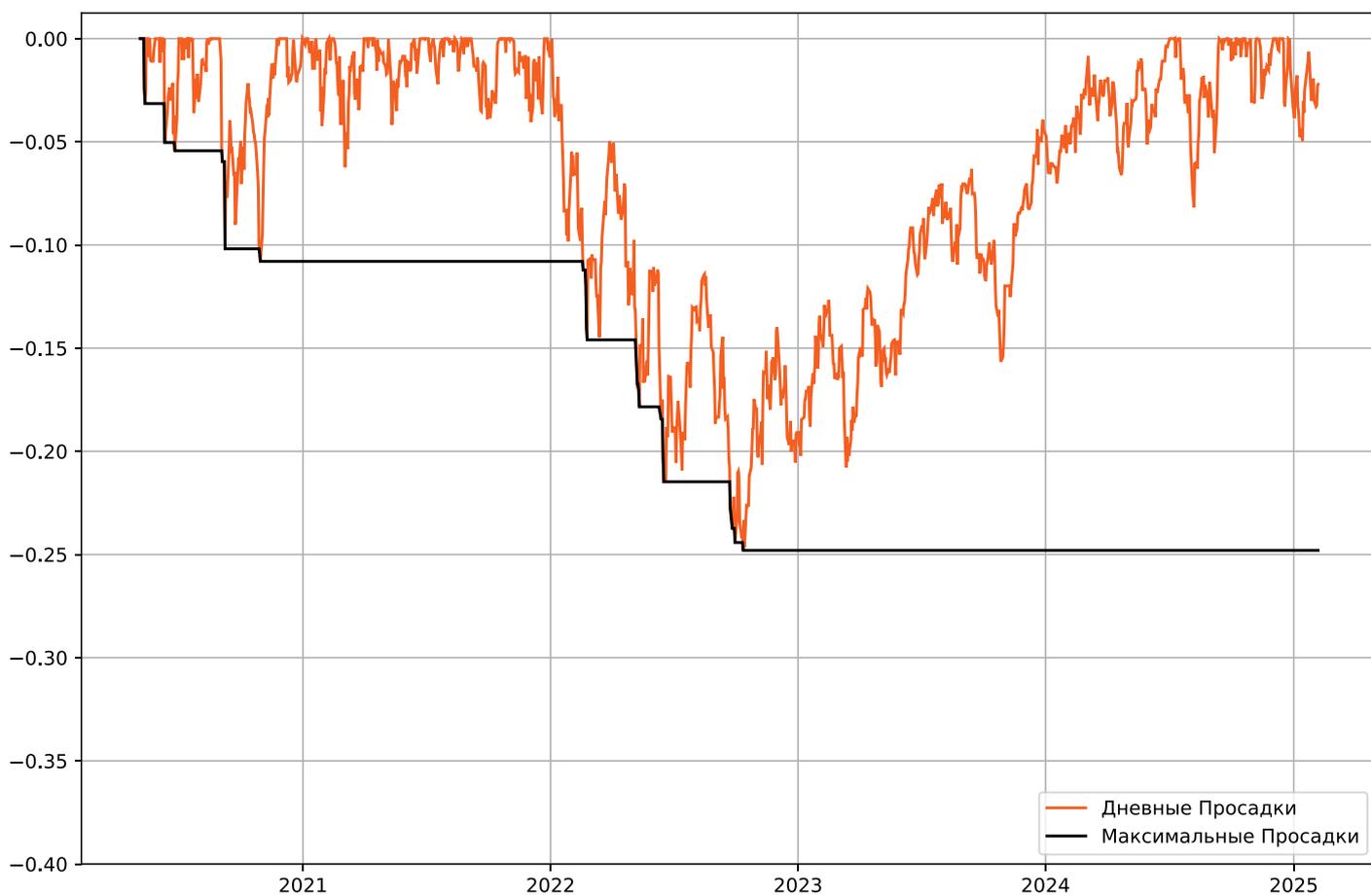
0,65

Золото

0,62

### МАКСИМАЛЬНЫЕ СНИЖЕНИЯ

График максимальных снижений показывает максимальные потери индекса на снижениях от предыдущего до следующего пика.



ПЕРИОД	ITS Shariah	S&P 500 Shariah	FTSE Shariah All-World	Золото
1 год	<b>24,80%</b>	28,23%	26,41%	20,43%
1 месяц	<b>11,68%</b>	12,87%	12,12%	8,95%



Индекс ITS Shariah был запущен 10 августа 2023 года. Данные до этой даты основаны на гипотетических бэк-тестах (т.е. на расчетах того, как индекс мог бы вести себя в течение этого периода времени, если бы он существовал), а не на фактической динамике индекса. Эти данные основаны на методологии индекса, действовавшей на дату его запуска. Поскольку торги на площадке ITS начались только 6 июня 2023 года, правила методологии индекса на периоде бэк-тестирования могли быть несколько смягчены в целях охвата достаточного числа ценных бумаг для моделирования динамики целевого рынка. Например, требования к универсалу, уровню рыночной капитализации и ликвидности могут быть ослаблены. Обычно динамика индекса на бэк-тестах и в ситуации реального расчета различается, поэтому фактическая доходность может быть ниже тестовых результатов. Динамика за предыдущий период - как фактическая, так и на бэк-тестах - не является указанием или гарантией динамики в будущем. Пожалуйста, ознакомьтесь внимательно с методологией на [www.itsx.kz](http://www.itsx.kz) для дополнительной информации об индексе, включая способы и время его ребалансировки, критерии для добавления и удаления акций, методы расчета и политику учета корпоративных действий. Результаты бэк-тестов динамики предназначены для использования только профессиональными участниками рынка ценных бумаг и не предназначены для розничных инвесторов.



Sahih Invest

## КОМПОНЕНТЫ

Предельное ограничение концентрации каждого компонента индекса ITS Shariah составляет 10%. Если вес одного или нескольких компонентов индекса (или сумма всех весов компонентов индекса одного эмитента) превышает 10% в день ребалансировки, избыточное значение веса распределяется пропорционально среди других компонентов индекса.

### КОМПОНЕНТЫ ИНДЕКСА НА ДАТУ ПОСЛЕДНЕЙ РЕБАЛАНСИРОВКИ

1	<b>AAPL</b>	APPLE INC.	<b>10,00%</b>
2	<b>MSFT</b>	MICROSOFT CORPORATION	<b>10,00%</b>
3	<b>NVDA</b>	NVIDIA CORPORATION	<b>10,00%</b>
4	<b>TSLA</b>	TESLA, INC.	<b>8,87%</b>
5	<b>AVGO</b>	BROADCOM INC.	<b>7,21%</b>
6	<b>LLY</b>	ELI LILLY AND COMPANY	<b>4,77%</b>
7	<b>V</b>	VISA INC.	<b>4,28%</b>
8	<b>MA</b>	MASTERCARD INCORPORATED CLASS A	<b>3,32%</b>
9	<b>XOM</b>	EXXON MOBIL CORPORATION	<b>3,30%</b>
10	<b>ORCL</b>	ORACLE CORPORATION	<b>3,19%</b>
11	<b>HD</b>	THE HOME DEPOT, INC.	<b>2,76%</b>
12	<b>PG</b>	THE PROCTER & GAMBLE COMPANY	<b>2,63%</b>
13	<b>JNJ</b>	JOHNSON & JOHNSON	<b>2,43%</b>
14	<b>CRM</b>	SALESFORCE, INC.	<b>2,17%</b>
15	<b>ABBV</b>	ABBVIE INC.	<b>2,12%</b>
16	<b>SAP</b>	SAP SE (ADR)	<b>2,11%</b>
17	<b>CVX</b>	CHEVRON CORPORATION	<b>1,90%</b>
18	<b>KO</b>	THE COCA-COLA COMPANY	<b>1,83%</b>
19	<b>MRK</b>	MERCK & CO., INC.	<b>1,71%</b>
20	<b>CSCO</b>	CISCO SYSTEMS, INC.	<b>1,63%</b>
21	<b>NOW</b>	SERVICENOW, INC.	<b>1,50%</b>
22	<b>TMO</b>	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC.	<b>1,48%</b>
23	<b>AZN</b>	ASTRAZENECA PLC	<b>1,44%</b>
24	<b>ABT</b>	ABBOTT LABORATORIES	<b>1,41%</b>
25	<b>PEP</b>	PEPSICO, INC.	<b>1,39%</b>
26	<b>ISRG</b>	INTUITIVE SURGICAL, INC.	<b>1,39%</b>
27	<b>AMD</b>	ADVANCED MICRO DEVICES, INC.	<b>1,34%</b>
28	<b>ADBE</b>	ADOBE INC.	<b>1,29%</b>
29	<b>QCOM</b>	QUALCOMM INCORPORATED	<b>1,26%</b>
30	<b>CAT</b>	CATERPILLAR INC.	<b>1,26%</b>



Индекс ITS Shariah был запущен 10 августа 2023 года. Данные до этой даты основаны на гипотетических бэк-тестах (т.е. на расчетах того, как индекс мог бы вести себя в течение этого периода времени, если бы он существовал), а не на фактической динамике индекса. Эти данные основаны на методологии индекса, действовавшей на дату его запуска. Поскольку торги на площадке ITS начались только 6 июня 2023 года, правила методологии индекса на периоде бэк-тестирования могли быть несколько смягчены в целях охвата достаточного числа ценных бумаг для моделирования динамики целевого рынка. Например, требования к универсалу, уровню рыночной капитализации и ликвидности могут быть ослаблены. Обычно динамика индекса на бэк-тестах и в ситуации реального расчета различается, поэтому фактическая доходность может быть ниже тестовых результатов. Динамика за предыдущий период - как фактическая, так и на бэк-тестах - не является указанием или гарантией динамики в будущем. Пожалуйста, ознакомьтесь внимательно с методологией на [www.its.kz](http://www.its.kz) для дополнительной информации об индексе, включая способы и время его ребалансировки, критерии для добавления и удаления акций, методы расчета и политику учета корпоративных действий. Результаты бэк-тестов динамики предназначены для использования только профессиональными участниками рынка ценных бумаг и не предназначены для розничных инвесторов.



Sahih Invest

## ВЕСА ПО СЕКТОРАМ



## МЕТОДОЛОГИЯ ШАРИАТСКОГО ОТБОРА (ПРОВЕРКИ)

Состав индекса состоит из компонентов с наибольшей рыночной капитализацией, которые соответствуют принципам шариата, определенным по методологии независимого эксперта на основе критериев, установленных ААОIFI.

Все компоненты индекса ITS Shariah проходят проверку на соответствие требованиям шариата по двум категориям: по деятельности (соответствие деятельности компании принципам шариата) и по бухгалтерскому учету (соответствие финансовых коэффициентов установленным пороговым значениям).

С 4 сентября 2024 года методология отбора компонентов была обновлена, что повлияло на состав индекса. Это обновление предполагает использование средней рыночной капитализации за 24 месяца вместо стоимости совокупных активов.