



Индекс ITS Shariah (валюта индекса – доллар США)

ОБ ИНДЕКСЕ | 10 мар 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 AAOIFI 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
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%
Золото	9,96%	-0,43%	13,34%	27,48%	71,65%



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.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 индекса предназначены для использования только профессиональными участниками рынка ценных бумаг и не предназначены для розничных инвесторов.



Sahih Invest

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

0,72

S&P 500 Shariah

0,80

FTSE Shariah All-World

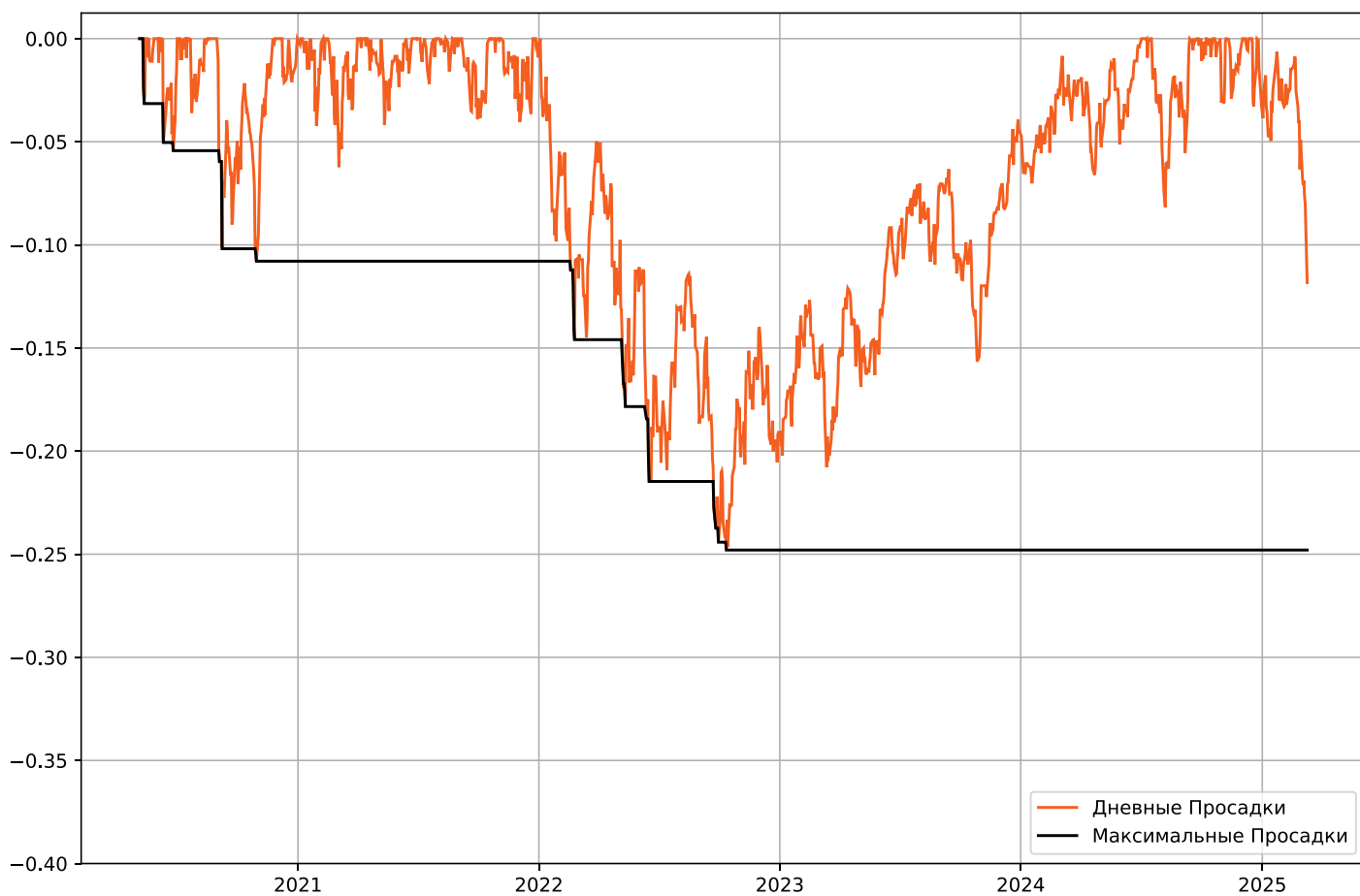
0,60

Золото

0,63

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	24,80%	28,23%	26,41%	20,43%
1 месяц	11,68%	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 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.



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	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%



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, уровням 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 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 AAOIFI.

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.



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 кэпвелсу, уровням 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 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.

