



ITS World Индексі (индекс валютасы – АҚШ доллары)

ИНДЕКС ТУРАЛЫ | 09-05-2025

ITS World Индексі

ITS World (USD) индексі Америка, Еуропа және Азия өңірлеріндегі, соның ішінде Қазақстандағы ірі компанияларды қамтиды.

ITS платформасының өтімділігінің арқасында жақсы теңдестірілген ITS World индексі Орталық Азияда қолжетімді барлық негізгі акцияларды бір тұтас себетте алудың бірегей мүмкіндігін ұсынады.

ДИНАМИКА

ИНДЕКСТІҢ ЖИНАҚТАЛҒАН ДИНАМИКАСЫ - ТАЗА ТАБЫС (АҚШ ДОЛЛАРЫ)



ИНДЕКС	ЖЫЛ БАСЫНАН БЕРІ	2022	2023	2024	БАРЛЫҚ МЕРЗІМГЕ
ITS WORLD	3,07%	-23,45%	28,29%	18,92%	103,84%
S&P 500	-3,77%	-19,44%	24,23%	23,31%	98,70%
NASDAQ 100	-4,52%	-32,97%	53,81%	24,88%	123,28%
Hang Seng	13,83%	-15,43%	-14,00%	18,38%	-4,92%



ITS World индексі 2023 жылдың 10 тамызында іске қосылды. Осы күнге дейінгі деректер индексің нақты динамикасына емес, гипотетикалық бэк-тесттерге негізделген (яғни, егер индекс бұрыннан бері бар болса, осы уақыт аралығында өзін қалай көрсете алатынын есептеу). Бұл деректер индексің 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 капиталдандыру және өтімділік деңгейлері төмендеуі мүмкін. Көбінесе бэк-тесттердегі және нақты өмірдегі индексің динамикасы әр түрлі болады, сондықтан нақты кірістілік тест нәтижелерінен төмен болуы мүмкін. Алдыңғы кезеңдегі динамика - нақтысы да, бэк-тесттағы да – болашақ динамиканың көрсеткіші немесе кепілді 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 бэк-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 WORLD

S&P 500

NASDAQ 100

Hang Seng

ШАРП КОЭФФИЦИЕНТІ

0,81

0,68

0,69

-0,07

МАКСИМАЛДЫ ТҮСУ

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



КЕЗЕҢ

ITS WORLD

S&P 500

NDX

HSI

1 жыл

30,56%

25,43%

35,50%

44,13%

1 ай

15,53%

13,74%

15,98%

25,98%



ITS World 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, максатты нарық динамикасын модельдеу үшін жеңілдетілді 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 кепілсіз 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 бэк-тест нәтижелері жеке инвесторларға емес, тек институционалды пайдалануға арналған.

КОМПОНЕНТТЕР

ITS World 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 сол аймақтағы индекстің басқа компоненттеріне пропорционалды түрде бөлінеді.

СОҒҒЫ ҚАЙТА ТЕҢГЕРІМДЕУ КҮНІНДЕГІ ИНДЕКС КОМПОНЕНТТЕРІ

АМЕРИКА

AAPL	APPLE INC.	5,04%
MSFT	MICROSOFT CORPORATION	4,46%
NVDA	NVIDIA CORPORATION	4,35%
AMZN	AMAZON.COM, INC.	3,24%
GOOG	ALPHABET INC. CLASS C	3,12%
GOOGL	ALPHABET INC. CLASS A	3,10%
META	META PLATFORMS, INC. CLASS A	2,36%
BRK B	BERKSHIRE HATHAWAY INC.	1,67%
AVGO	BROADCOM INC.	1,39%
TSLA	TESLA, INC.	1,39%
LLY	ELI LILLY AND COMPANY	1,15%
WMT	WALMART INC.	1,15%
JPM	JPMORGAN CHASE & CO.	1,06%
V	VISA INC.	1,01%
MA	MASTERCARD INCORPORATED CLASS A	0,76%
XOM	EXXON MOBIL CORPORATION	0,73%
UNH	UNITEDHEALTH GROUP INCORPORATED	0,70%
COST	COSTCO WHOLESALE CORPORATION	0,67%
ORCL	ORACLE CORPORATION	0,65%

АЗИЯ

BABA	ALIBABA GROUP HOLDING LIMITED ADR	7,66%
TM	TOYOTA MOTOR CORPORATION	6,11%
SONY	SONY GROUP CORPORATION	3,74%
IBN	ICICI BANK LIMITED	2,75%



NTES	NETEASE, INC.	1,68%
JD	JD.COM, INC. ADR	1,54%
TEAM	ATLASSIAN CORPORATION CLASS A	1,53%
TAK	TAKEDA PHARMACEUTICAL COMPANY LIMITED	1,18%
BIDU	BAIDU, INC.	0,80%
LI	LI AUTO INC.	0,70%
CHKP	CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.	0,61%
YUMC	YUM CHINA HOLDINGS, INC.	0,46%
TEVA	TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LIMITED, ADR	0,45%
CYBR	CYBERARK SOFTWARE LTD.	0,44%
MNDY	MONDAY.COM LTD.	0,35%

ЕУРОПА

SAP	SAP SE (ADR)	4,93%
AZN	ASTRAZENECA PLC	3,48%
NVS	NOVARTIS AG	3,34%
SHEL	SHELL PLC	3,11%
SPOT	SPOTIFY TECHNOLOGY S.A.	1,83%
BUD	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	1,79%
CB	CHUBB LIMITED	1,74%
UBS	UBS GROUP AG	1,53%
RIO	RIO TINTO PLC, ADR	1,53%
BTI	BRITISH AMERICAN TOBACCO P.L.C.	1,38%
RACE	FERRARI N.V.	1,25%
NXPI	NXP SEMICONDUCTORS N.V.	0,78%
ALC	ALCON INC.	0,69%
GRMN	GARMIN LTD.	0,61%

ҚАЗАҚСТАН

KMG	NC "KAZMUNAYGAS" JSC	2,11%
KSPI	JOINT STOCK COMPANY KASPI.KZ	1,89%



ИНДЕКС КОНЦЕНТРАЦИЯСЫ

Индекс концентрациясы индекстегі негізгі позициялардың жалпы салмағын өлшейді.

