



Индекс ITS World (валюта индекса – доллар США)

ОБ ИНДЕКСЕ | 07 авг 2025

Индекс ITS World

Индекс ITS World (USD) охватывает крупные компании в регионах Америки, Европы и Азии, включая Казахстан.

Благодаря ликвидности платформы ITS, хорошо сбалансированный индекс ITS World представляет уникальную возможность получить все основные акции, доступные в Центральной Азии, в одной компактной корзине.

ДИНАМИКА

НАКОПЛЕННАЯ ДИНАМИКА ИНДЕКСА – ЧИСТЫЙ ДОХОД (ДОЛЛАР США)



ИНДЕКС	С НАЧАЛА ГОДА	2024	2023	2022	ЗА ВСЕ ВРЕМЯ
ITS WORLD	12,75%	18,92%	28,29%	-23,45%	122,99%
S&P 500	7,79%	23,31%	24,23%	-19,44%	122,58%
NASDAQ 100	11,31%	24,88%	53,81%	-32,97%	160,32%
Hang Seng	23,66%	18,38%	-14,00%	-15,43%	3,29%



Индекс ITS World 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 юниверсу, 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 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

ITS WORLD

S&P 500

NASDAQ 100

Hang Seng

КОЭФФИЦИЕНТ ШАРПА

0,87

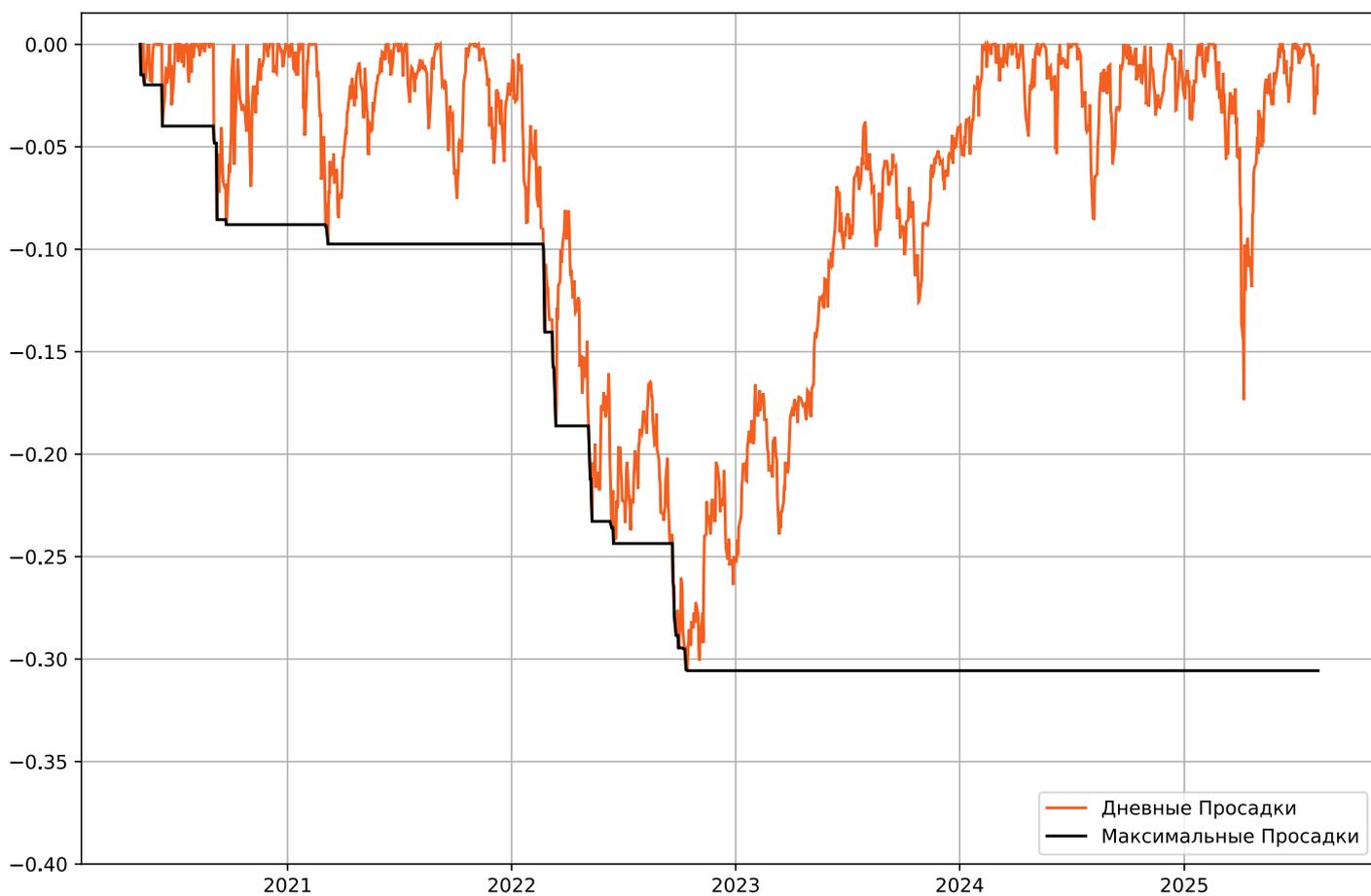
0,80

0,82

0,00

МАКСИМАЛЬНЫЕ СНИЖЕНИЯ

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



ПЕРИОД

ITS WORLD

S&P 500

NDX

HSI

1 год

30,56%

25,43%

35,50%

44,13%

1 месяц

15,53%

13,74%

15,98%

25,98%



Индекс ITS World 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 юниверсалу, 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 предназначены для использования только профессиональными участниками рынка ценных бумаг и не предназначены для розничных инвесторов.

КОМПОНЕНТЫ

Предельное ограничение концентрации каждого компонента индекса ITS World 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, относящихся к одному и тому же региону.

КОМПОНЕНТЫ ИНДЕКСА НА ДАТУ ПОСЛЕДНЕЙ РЕБАЛАНСИРОВКИ

АМЕРИКА

NVDA	NVIDIA CORPORATION	5,07%
MSFT	MICROSOFT CORPORATION	4,99%
AAPL	APPLE INC.	4,28%
AMZN	AMAZON.COM, INC.	3,17%
GOOG	ALPHABET INC. CLASS C	2,97%
GOOGL	ALPHABET INC. CLASS A	2,96%
META	META PLATFORMS, INC. CLASS A	2,41%
AVGO	BROADCOM INC.	1,68%
BRK B	BERKSHIRE HATHAWAY INC.	1,48%
TSLA	TESLA, INC.	1,44%
WMT	WALMART INC.	1,08%
JPM	JPMORGAN CHASE & CO.	1,07%
LLY	ELI LILLY AND COMPANY	0,96%
V	VISA INC.	0,96%
ORCL	ORACLE CORPORATION	0,78%
NFLX	NETFLIX, INC.	0,72%
MA	MASTERCARD INCORPORATED CLASS A	0,72%
XOM	EXXON MOBIL CORPORATION	0,65%
COST	COSTCO WHOLESALE CORPORATION	0,61%

АЗИЯ

TSM	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING COMPANY LTD.	10,00%
BABA	ALIBABA GROUP HOLDING LIMITED ADR	4,89%
TM	TOYOTA MOTOR CORPORATION	4,06%
PDD	PDD HOLDINGS INC., ADR	2,65%



IBN	ICICI BANK LIMITED	2,07%
NTES	NETEASE, INC.	1,39%
TEAM	ATLASSIAN CORPORATION CLASS A	0,93%
JD	JD.COM, INC. ADR	0,83%
TAK	TAKEDA PHARMACEUTICAL COMPANY LIMITED	0,80%
BIDU	BAIDU, INC.	0,52%
LI	LI AUTO INC.	0,50%
CHKP	CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.	0,41%
TEVA	TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LIMITED, ADR	0,34%
CYBR	CYBERARK SOFTWARE LTD.	0,33%
YUMC	YUM CHINA HOLDINGS, INC.	0,29%

ЕВРОПА

SAP	SAP SE (ADR)	5,08%
NVS	NOVARTIS AG	3,34%
AZN	ASTRAZENECA PLC	3,21%
SHEL	SHELL PLC	2,99%
SPOT	SPOTIFY TECHNOLOGY S.A.	2,05%
BUD	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	1,92%
CB	CHUBB LIMITED	1,65%
UBS	UBS GROUP AG	1,56%
BTI	BRITISH AMERICAN TOBACCO P.L.C.	1,53%
RIO	RIO TINTO PLC, ADR	1,42%
RACE	FERRARI N.V.	1,26%
NXPI	NXP SEMICONDUCTORS N.V.	0,78%
ALC	ALCON INC.	0,63%
GRMN	GARMIN LTD.	0,58%

КАЗАХСТАН

KMG	NC "KAZMUNAYGAS" JSC	2,45%
KSPI	JOINT STOCK COMPANY KASPI.KZ	1,55%



КОНЦЕНТРАЦИЯ ИНДЕКСА

Концентрация индекса измеряет суммарный вес крупнейших компаний индексе.

