



Индекс ITS World (валюта индекса – доллар США)

ОБ ИНДЕКСЕ | 09 мая 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	2022	2023	2024	ЗА ВСЕ ВРЕМЯ
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%



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

КОЭФФИЦИЕНТ ШАРПА

ITS WORLD

0,81

S&P 500

0,68

NASDAQ 100

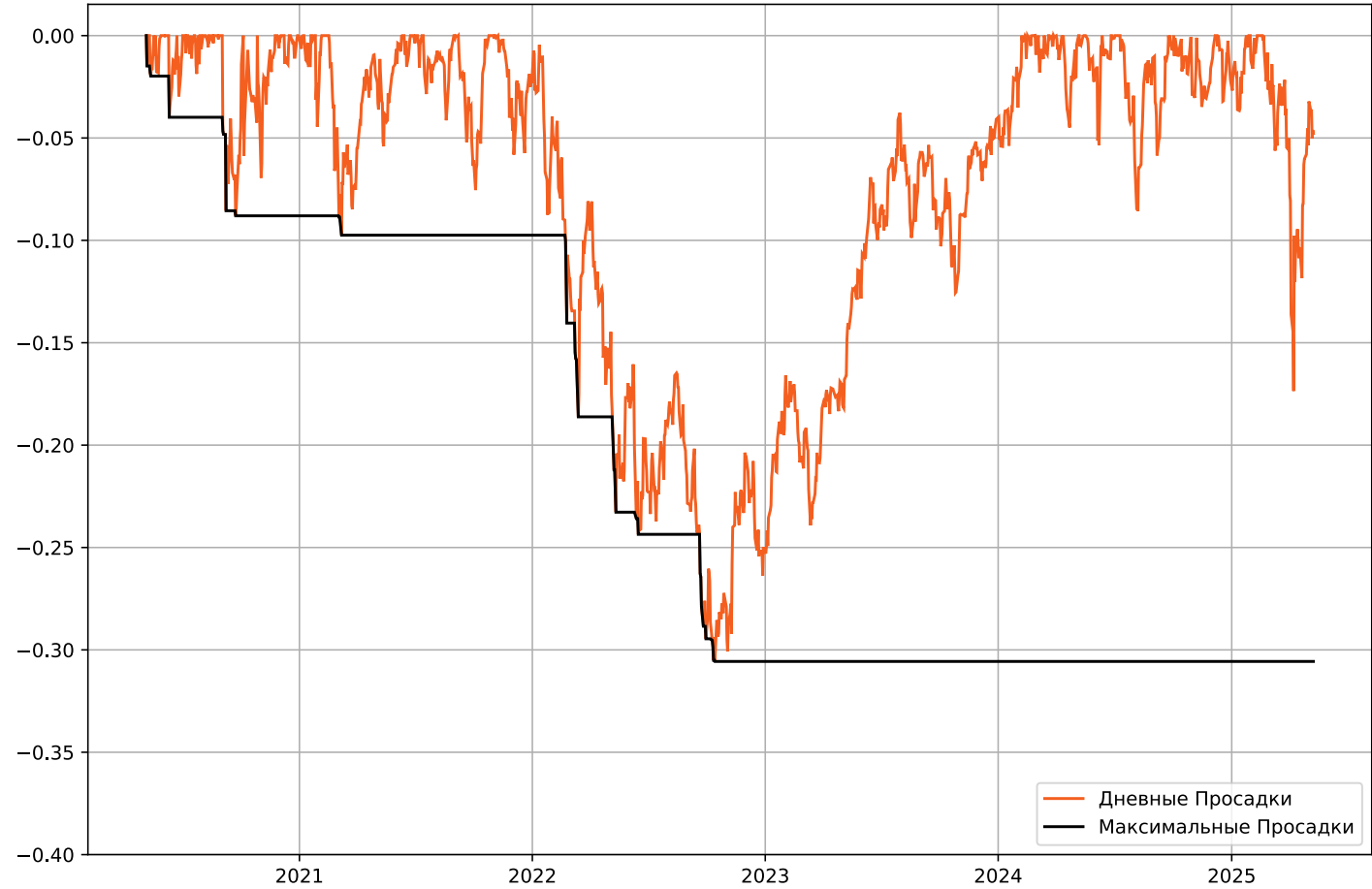
0,69

Hang Seng

-0,07

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 универсуму, 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

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%



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.

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%

ЕВРОПА

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%

КАЗАХСТАН

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



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.

КОНЦЕНТРАЦИЯ ИНДЕКСА

Концентрация индекса измеряет суммарный вес крупнейших компаний индексе.

