



Индекс ITS World (валюта индекса – доллар США)

ОБ ИНДЕКСЕ | 07 ноя 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	23,56%	18,92%	28,29%	-23,45%	144,36%
S&P 500	14,40%	23,31%	24,23%	-19,44%	136,23%
NASDAQ 100	19,26%	24,88%	53,81%	-32,97%	178,91%
Hang Seng	30,62%	18,38%	-14,00%	-15,43%	9,11%



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 предназначаются для розничных инвесторов.

КОЭФФИЦИЕНТ ШАРПА

Коэффициент Шарпа измеряет эффективность инвестиций в индекс за последние пять лет по сравнению с безрисковыми вложениями (3-месячные казначейские векселя США), с учетом корректировки на риск индекса.

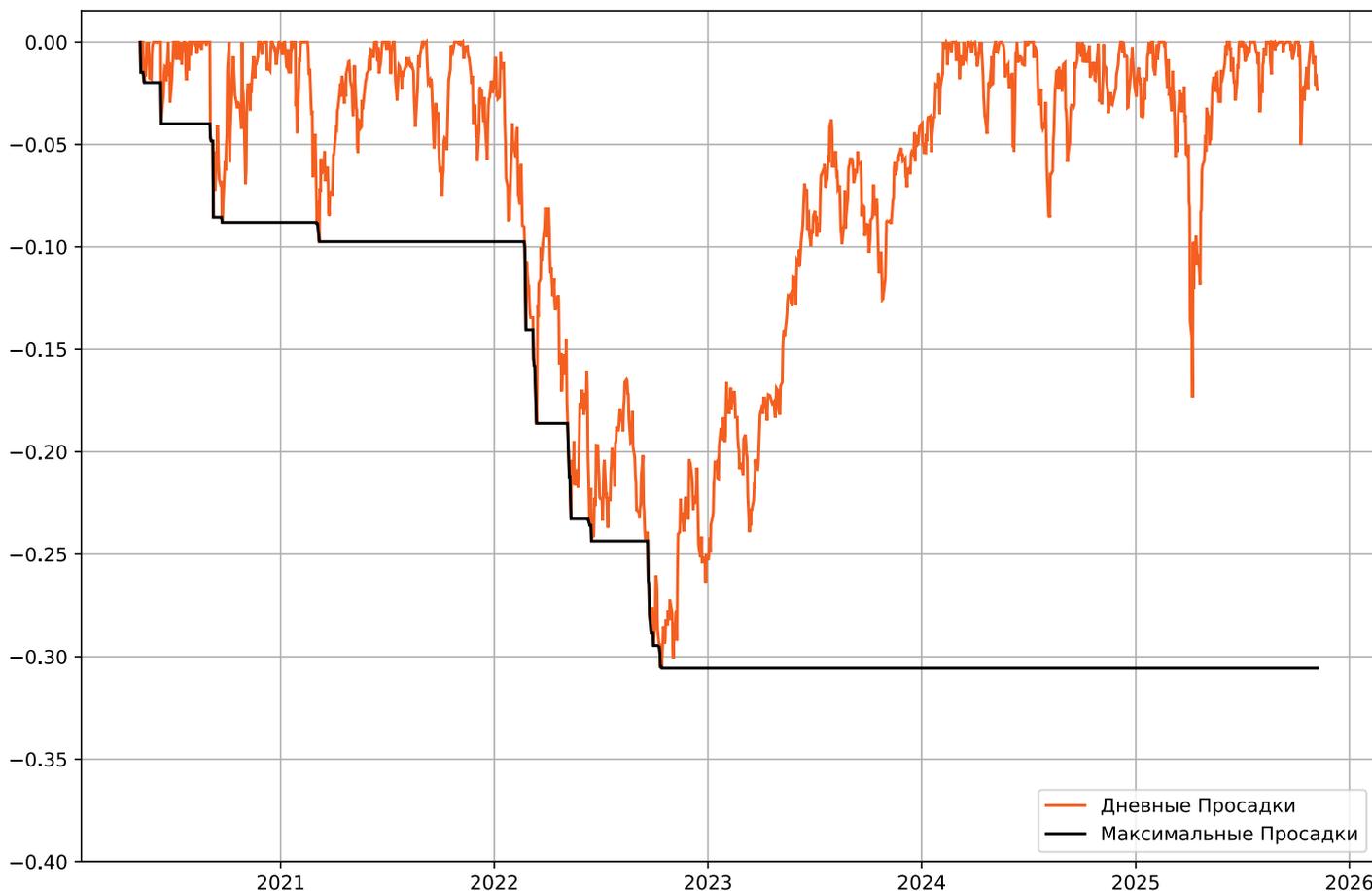
ИНДЕКС

КОЭФФИЦИЕНТ ШАРПА

ITS WORLD	0,71
S&P 500	0,73
NASDAQ 100	0,73
Hang Seng	-0,06

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 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 предназначаются 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	5,36%
MSFT	MICROSOFT CORPORATION	4,63%
AAPL	APPLE INC.	4,37%
GOOG	ALPHABET INC. CLASS C	3,44%
GOOGL	ALPHABET INC. CLASS A	3,43%
AMZN	AMAZON.COM, INC.	2,91%
META	META PLATFORMS, INC. CLASS A	2,25%
AVGO	BROADCOM INC.	1,89%
TSLA	TESLA, INC.	1,55%
BRK B	BERKSHIRE HATHAWAY INC.	1,28%
JPM	JPMORGAN CHASE & CO.	1,00%
WMT	WALMART INC.	0,99%
ORCL	ORACLE CORPORATION	0,93%
LLY	ELI LILLY AND COMPANY	0,83%
V	VISA INC.	0,81%
MA	MASTERCARD INCORPORATED CLASS A	0,63%
NFLX	NETFLIX, INC.	0,61%
XOM	EXXON MOBIL CORPORATION	0,58%
JNJ	JOHNSON & JOHNSON	0,53%

АЗИЯ

TSM	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING COMPANY LTD.	10,00%
BABA	ALIBABA GROUP HOLDING LIMITED ADR	5,62%
TM	TOYOTA MOTOR CORPORATION	3,99%
PDD	PDD HOLDINGS INC., ADR	2,79%



IBN	ICICI BANK LIMITED	1,77%
NTES	NETEASE, INC.	1,41%
JD	JD.COM, INC. ADR	0,74%
TAK	TAKEDA PHARMACEUTICAL COMPANY LIMITED	0,72%
TEAM	ATLISSIAN CORPORATION CLASS A	0,67%
BIDU	BAIDU, INC.	0,61%
LI	LI AUTO INC.	0,38%
CYBR	CYBERARK SOFTWARE LTD.	0,37%
TEVA	TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LIMITED, ADR	0,34%
CHKP	CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.	0,32%
KEP	KOREA ELECTRIC POWER CORPORATION	0,27%

ЕВРОПА

SAP	SAP SE (ADR)	4,51%
AZN	ASTRAZENECA PLC	3,56%
NVS	NOVARTIS AG	3,48%
SHEL	SHELL PLC	3,02%
SPOT	SPOTIFY TECHNOLOGY S.A.	2,03%
UBS	UBS GROUP AG	1,80%
BTI	BRITISH AMERICAN TOBACCO P.L.C.	1,70%
BUD	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	1,68%
CB	CHUBB LIMITED	1,57%
RIO	RIO TINTO PLC, ADR	1,49%
RACE	FERRARI N.V.	1,15%
NXPI	NXP SEMICONDUCTORS N.V.	0,80%
GRMN	GARMIN LTD.	0,66%
ALC	ALCON INC.	0,55%

КАЗАХСТАН

KMG	NC "KAZMUNAYGAS" JSC	2,57%
KSPI	JOINT STOCK COMPANY KASPI.KZ	1,43%



КОНЦЕНТРАЦИЯ ИНДЕКСА

Концентрация индекса измеряет суммарный вес крупнейших компаний индексе.

