

ציון יחסי לנכסים ולשירותים אחרים בהתאם לסעיף 17 (ב) לתקנות ההסדרה

הערכת איכות ניהול - Investment Manager Quality (MQ) Assessment

הערכת איכות ניהול הינה הערכת מידרוג בדבר אופן הניהול והתפעול של חברה המנהלת השקעות. במסגרת הערכה זו מידרוג בוחנת את מעמד החברה בענף, איכות התשתית הניהולית התפעולית והפיננסית של החברה המנהלת, ההשפעות התפעוליות והניהוליות הכרוכות בשירותי מסחר, ניהול הנכסים, בקרה וניהול סיכונים, איכות ביצועי מערך ההשקעות, כמו גם את יכולותיה של החברה המנהלת לנהל את הסיכונים אליהם היא עצמה חשופה ואת הסיכונים אליהם חשופים המשקיעים או החוסכים.

דירוג קרנות כספיות וקרנות אג"ח - Money Market Fund (MMF)

במסגרת דירוג קרנות כספיות (לרבות קפ"מ) וקרנות אג"ח נבחנים פרופיל האשראי של הקרן, פרופיל היציבות של הקרן ואיכות מנהל הקרן בהיבט ניהול הסיכונים והתפעול. למען הסר ספק, הדירוג אינו בוחן את התשואה/ההפסד על נכסי הקרן או התנודתיות בשווי נכסיה.

מערכת לדירוג קרנות מחקות וקרנות סל

מערכת דירוג קרנות מחקות וקרנות סל (להלן: "קרנות") פותחה במיזם משותף עם חברת פרדיקטה ונועדה לספק למשתמשים דירוג לקרנות מסוג זה. דירוג הקרנות מתבסס, בין היתר, על חישוב סטיית התקן עבור סדרת ההפרשים בין המדד הרלוונטי לבין ה-NAV של הקרנות, אמידת ההפרש המצטבר בין ביצועי הקרנות לשינויים במדד, אמידת ביצועי הקרנות תוך שמירת על פרופיל סיכון הזהה לסיכון המדד, השוואת ביצועי הקרנות ביחס לקבוצת הייחוס המכילה קרנות העוקבות אחר אותו מדד זהה להשוואה, אמידת תנודתיות במדד הנעקב ומידת התנודתיות התוך יומית.

מערכת "אורות אדומים" לקרנות מחקות וקרנות סל

מערכת "אורות אדומים" פותחה במיזם משותף עם חברת פרדיקטה ונועדה לבחון אירועים בקרנות המחקות ובקרנות הסל, אשר יש בהם להתריע על כשל קיים או אפשרי בקרן. זהו נדבך נוסף למערכת לדירוג הקרנות, כמתוארת לעיל, אשר פותחה על מנת להוות בחינה משלימה של אירועים חריגים בנוסף למידרג המתקבל משקלול הפרמטרים המתוארים לעיל. במסגרת זו נבחנים היבטים איכותיים וכמותיים שונים.

דירוג קופות גמל וקרנות השתלמות

דירוג ביצועי קופות גמל וקרנות השתלמות על בסיס נתונים כמותיים: תשואה, מדד שארפ חסר סיכון, יתרת נכסים, מדד נזילות, מדד אלפא, שיעור הנכסים המסוכנים, צבירות/גריעות ודמי ניהול.