

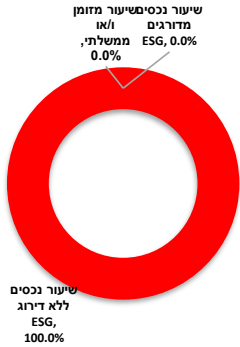
# A.B SmartBeta 125 Low Volatility (4A) ת"א

סיווג הקרן: מניות בארץ  
תת סיווג: מניות לפי שווי שוק-Mid Cap & Large  
הקרן:

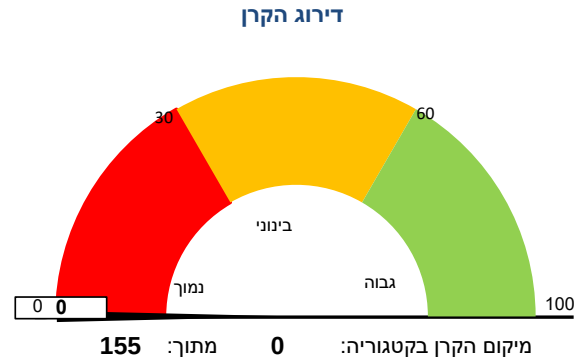
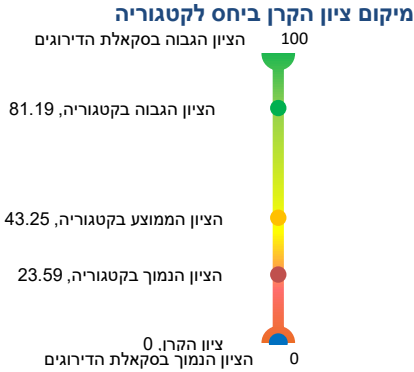
ללא דירוג

מספר קרן מחקה: 5119201  
חודש דירוג: פברואר 2025  
מנהל השקעות: אלטשולר שחם

## פילוח הדירוג של נכסי הקרן המחקה



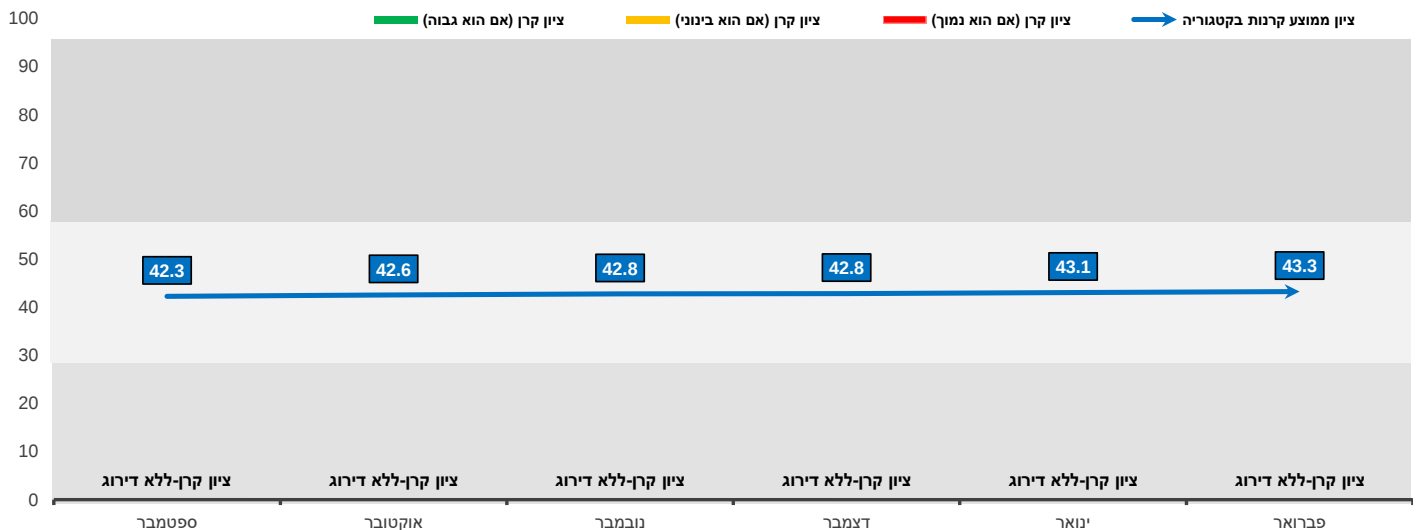
## הערכת ESG לקרן מחקה



## עשרת הקרנות המחקות המדורגות בדירוג הגבוה/הנמוך ביותר בקטגוריה

| דירוג חיובי                       | דירוג שלילי                                        |
|-----------------------------------|----------------------------------------------------|
| מח אינדקס בנקים ישראל ATF         | א צמיחה"ת (4A) PTF                                 |
| אינדקס בנקים ישראל PTF (4A)       | קסם ETF4 (A) ת"א צמיחה                             |
| הראל מחקה (A4) אינדקס בנקים ישראל | תכלית סל (40) ת"א צמיחה                            |
| תכלית PTF (40) אינדקס בנקים ישראל | א צמיחה"ת (4A) מחקה MTF                            |
| הראל סל (A4) אינדקס בנקים ישראל   | מח אנ בנישרמנפנימון MTF                            |
| פסגות ETF (A4) אינדקס בנקים ישראל | הראל סל (A4) ת"א 60SME                             |
| קסם ETF4 (A) אינדקס בנקים ישראל   | קסם ETF4 (A) ת"א 60SME                             |
| תכלית סל (40) אינדקס בנקים ישראל  | תכלית סל (40) ת"א 60SME                            |
| י.ל סל ת"א בנקים                  | 60SME ת"א (4A) מחקה MTF                            |
| ילין לפידות מחקה (A4) ת"א בנקים   | א.י.א. מחקה (A4) משולבת מניות נדל"ן ישראליות חודשי |

## התפתחות דירוג הקרן המחקה ביחס לקטגוריה ב-6 החודשים האחרונים



## הערות לדירוג:

- הדירוג הינו יחסי ומתבסס על ניתוח הרכב מנפיקים המוחזקים בקרן ומתאמת למתודולוגיית הדירוג בבנק.
- תמהיל הנכסים המדורגים בקרן מוצגים בגרף פילוח הדירוג של נכסי הקרן מעלה (החזקות באגח ממשלתי ומזומן אינן זוכות לציון).
- סרגל הדירוג נע בין 0 ל 100 (עד 30 נמוך, עד 60 בינוני, מעל = גבוה).
- הדירוג מבוסס על נתונים ציבוריים בלבד.

## הסבר לגבי ESG:

הדירוג מבוצע על ידי גופים מקצועיים, ומתבסס על ניתוח מערכתי של פרמטרים רבים ומגוונים. התפיסה העיקרית מאחורי ESG היא שפרמטרים אלו משפיעים על ביצועים ארוכי הטווח והתמודדות עם סיכונים והזדמנויות עסקיות. כלומר, חברות וארגונים שמקדמים את ענייני הסביבה, החברה וממשל תאגידי בתהליך הערכה שלהם עשויים להצליח יותר בתחום הפיננסי ובשמירה על יכולת התמודדותם עם אתגרים וסיכונים.

דוגמאות להיבטי סביבה (Environmental): פליטות פחמן, שימוש באנרגיה, דוגמאות להיבטי חברה (Social): שרשרת אספקה, בטיחות, עובדים וקבילה. דוגמאות להיבטי ממשל תאגידי (Governance): איכות ניהול, אתיקה, שקיפות ועוד.

ניתוח ה-ESG המוצג במסמך זה מתבסס על ניתוח הרכב הניירות ערך של הקרן ועמידת דירוג ה-ESG של כל אחד מהם, המביאים ליצירת ציון כולל לקרן.