

עדכון הרכב מדדים פברואר 2022 – הוכן ע"י אורי טל-טנא עבור כלכליסט

סימולציה של עדכון הרכב מדדים פברואר 2022, נכון ל 23.12, תחת ההנחה: מיזוג פרשמרקט לתוך פז נפט יושלם לפני המועד הקובע לעדכון. אם ההנחה לא תממש, תמנע כניסת המניה האחרונה למדדי תא-90 i sme60, או לחלופין תצא ממדדים אלו מניה נוספת.

עדכון הרכב המדדים – פברואר 2022

המועד הקובע לעדכון הרכב המדדים של פברואר יתקיים ב 13.1. העדכון יתבסס על ממוצע מחירי המניות בין ה 2.1 ל 13.1. העדכון עצמו יכנס לתוקף בשלב נעילת המסחר של ה 3.2.

מדד תא-35

תנאי כניסה – דרוג 30 ומעלה מבין מניות מאגר רימון.

תנאי יציאה – דרוג 40 ומטה מבין מניות מאגר רימון.

מניית פריגו יוצאת מהמדד בקראת מחיקתה מהמסחר. לכן המניה הגדולה ביותר מחוץ למדד תכנס בודאות. מניה נוספת תכנס אם תדורג 30 ומעלה. לחלופין אם מניה מהמדד תדורג 40 ומטה היא תצא, והמניה השניה בדרוג שלא נכללת במדד תכנס.

שינויים במדד תא-35 אם העדכון היה מתבסס על נתוני ה 23.12

יוצאות			נכנסות		
הערה	מניה	דרוג	הערה	מניה	דרוג
לקראת מחיקה ממסחר	פריגו	-		קבון	30

קבון מדורגת 30, דלק קידוחים 31. זאת שתדורג במקום הגבוה יותר תכנס למדד. סביר שדלק קידוחים תחלק דיבידנד בסוף החודש לצרכי מיסוי מחזיקי יחידות השתתפות שיפגע בסיכויי הכניסה שלה למדד. השניה תכנס למדד רק אם גם היא תדורג 30 ומעלה, או שהמניה הקטנה במדד תדורג 40 ומטה. פוקס (דרוג 34) ואנלייט (דרוג 35) נמצאות מאחור וללא הנפקה גדולה או זינוק חד במניה הן לא יכנסו למדד.

בתחתית אנרג'יקס מדורגת 39, אך בפער גבוה יחסית מעל המקום ה 40. אם תרדו לדרוג ה 40 ומטה היא תצא מהמדד. בתרחיש זה שתי מניות יכנסו למדד.

מדד תא-90

תנאי כניסה – דרוג 80 ומעלה מבין מניות מאגר רימון שלא יכללו במדד תא-35.

תנאי יציאה – דרוג 100 ומטה מבין מניות מאגר רימון של יכללו במדד תא-35.

מדד תא-90 מכיל כעת 95 מניות והוא יחזור להכיל 90 מניות לאחר העדכון. פרשמרקט צפויה להתמזג לתוך פז נפט. המודל מניח שפרשמרקט לא תכלל במדד. בשלב זה מסתמן שהרכב המדד יקבע לפי תנאי הכניסה (דרוג 80 ומעלה) ושהחזרת הרכב המדד ל 90 מניות תוביל ליציאה של מניות למרות שהן מדורגות מעל לסף היציאה.

שינויים במדד תא-90 אם העדכון היה מתבסס על נתוני ה 23.12

יוצאות			נכנסות		
הערה	מניה	דרוג	הערה	מניה	דרוג
מעבר ל 35	קנון	-		תורפז	52
תלוי בהשלמת עסקה	בראק אן וי	-		פרשקובסקי	53
	אקוואריוס מנוע	121		אורמד	69
	ג'נסל	116		אילקס מדיקל	71
	אפולו פאוור	114		פולירם	74
	אוגווינד	112	גבולית	אאורה	79
	אלומיי	109			
	קומפיוג'ן	106			
	קרור	100			
גבולית	גילת	99			

הכניסה של פרשקובסקי, תורפז ואילקס מדיקל למדד ודאית. מניית אורמד ירדה בחדות לאחרונה, ואם תמשיך הירידה החדה במחיר המניה היא עלולה שלא להיכנס למדד. הסיכוי של פולירם להיכנס למדד גבוה מאוד. אאורה עלתה לדרוג ה 79 ממנו נכנסים למדד, אך כדי להיכנס היא תצטרך לשמור על דרוג 80 לפחות. ויתניה (דרוג 81) ונאוויטס (דרוג 82) יתמודדו גם כן על מקום במדד.

כמות היוצאות מהמדד תלויה בכמות המניות שיכנסו. בסבירות רבה ג'נסל, אקוואריוס מנועים, קומפיוג'ן, אוגווינד, אפולו פאוור, אלומיי וקרור יצאו מהמדד. אם העדכון היה נערך לפי נתוני ה 23.12 גם גילת הייתה יוצאת מהמדד. מניות נוספות בסיכון הן: אלוט, ג'נריישן, דיפלומט ובנוס. זהות היוצאות יהיו תלויות בקרבות התחתית של מדד תא-90.

תנאי כניסה – דרוג 40 ומעלה מבין מניות מאגר רימון שלא יכללו במדד תא-125.

תנאי יציאה – דרוג 80 ומטה מבין מניות מאגר רימון של יכללו במדד תא-125.

תנאי כניסה במסלול המהיר – דרוג 50 ומעלה מבין מניות מאגר רימון שלא יכללו במדד תא-125.

מדד SME60 מכיל כעת 65 מניות. אם מניית אייקון גרופ תכנס אליו במסגרת המסלול המהיר הוא יכיל 61 מניות אחרת יכיל 60 מניות. למדד תכנס כל מניה שתדורג 40 ומעלה מבין מניות הרימון שלא יכללו בתא-125. כמות היוצאות תקבע לפי כמות הנכנסות (כדי לצמצם את מספר המניות במדד חזרה ל 61 או 60).

שינויים במדד sme60 אם העדכון היה מתבסס על נתוני ה 23.12

יוצאות			נכנסות		
הערה	מניה	דרוג	הערה	מניה	דרוג
מעבר ל 90	תורפז	-		אקוואריוס מנוע	31
מעבר ל 90	אורמד	-		ג'נסל	26
מעבר ל 90	אילקס מדיקל	-		אפולו פאוור	24
מעבר ל 90	פולירם	-		אוגווינד	22
מעבר ל 90	אאורה	-		אלומיי	19
החזקות ציבור	פמס	-		קומפיוג'ן	16
	על בד	109		קרור	10
	אנלייבקס	101		גילת	9
	פורסייט	94		שירותי בנק אוטו	25
	ספאנטק	82		חנן מור	35
	גלוברנדס	74			
	פנורפליט	73			
	רבל	72			
	מניף	70			
גבולית	בית שמש	67			

המדד יקלוט 8 מניות ממדד תא-90 ועוד את שב"א וכנראה גם חנן מור. מעט מאחור טופ גאם (דרוג 44) וקיסטון ריט (דרוג 47) יתמודדו על מקום במדד רק אם ישפרו מהותית את הדרוג שלהן. אייקון גרופ צריכה להיות מדורגת 50 כדי להיכנס במסלול המהיר, כעת היא מדורגת 51 – דרוג שלא מכניס אותה למדד.

בצד היוצאות צפויה תחרות צמודה, כאשר גם פנינסולה, כפרית, אספן גרופ ומשק אנרגיה נמצאות בסיכון ליציאה מהמדד.

מדד צמיחה

למדד צמיחה יכנסו מניות עם שיעור החזקות ציבור גבוה מ 15%, ערך שוק של החזקות ציבור מעל ל 40 מיליון ש"ח ומחיר מניה גבוה מ 50 אגורות (צריכה לעמוד בכל שלושת התנאים).
מהמדד יצאו יכנסו מניות עם שיעור החזקות ציבור גבוה מ 15%, ערך שוק של החזקות ציבור מעל ל 40 מיליון ש"ח ומחיר מניה גבוה מ 50 אגורות. תנאי הכניסה במסלול המהיר זהה לתנאי למניעת יציאה מהמדד.

שינויים במדד צמיחה אם העדכון היה מתבסס על נתוני ה 23.12

יוצאות		נכנסות	
הערה	מניה	הערה	מניה
מעבר לתא-125	פרשקובסקי	מעבר מ תא90	בראק אן וי
מעבר ל sme60	שירותי בנק אוטו	מעבר מ sme60	פמס
מעבר ל sme60	חנן מור	מעבר מ sme60	על בד
מעבר ל sme60	טופ גאם	מעבר מ sme60	אנלייבקס
	ג'י.פי גלובל	מעבר מ sme60	פורסייט
	פיט השקעות יהש	מעבר מ sme60	ספאנטק
	איידנטי	מעבר מ sme60	גלוברנדס
	קנאשור	מעבר מ sme60	פאורפליט
	שמיים	מעבר מ sme60	רבל
	פארמוקן	מעבר מ sme60	מניף
		מעבר מ sme60	בית שמש
			אייקון גרופ
			ארנה גרופ
			הכשרה התחדשות
			האב
		מסלול מהיר	טורבוג'ן
		מסלול מהיר	סיפיה וויז'ן
			טקטונה
			ספרינג
			נוסטרומו
		מסלול מהיר	קונטיניואל
			סייפ-טי גרופ
		גבולית, תלויה גם בהחלטת הבורסה.	לזון נדל"ן

מניות שיכנסו למדד אם תחול עליה קלה במחירן הן: טכנ גילוי אש גז, סטורג' דרופ, פרידנזון, אנדימד

מדדים נוספים:

מדד נדל"ן

שינויים במדד נדל"ן אם העדכון היה מתבסס על נתוני ה 23.12

יוצאות		נכנסות	
הערה	מניה	הערה	מניה
			ארנה גרופ
			הכשרה התחדשות

מדד נדל"ן מניב ישראל

שינויים במדד נדל"ן מניב ישראל אם העדכון היה מתבסס על נתוני ה 23.12

יוצאות		נכנסות	
הערה	מניה	הערה	מניה
			ארנה גרופ

מדד בניה

שינויים במדד בניה אם העדכון היה מתבסס על נתוני ה 23.12

יוצאות		נכנסות	
הערה	מניה	הערה	מניה
			הכשרה התחדשות

מדד גלובל בלוטק

שינויים במדד גלובל בלוטק אם העדכון היה מתבסס על נתוני ה 23.12

יוצאות		נכנסות	
הערה	מניה	הערה	מניה
	פיט השקעות יהש		האב
	איידנטי		טורבוג'ן
	פארמוקן		סיפיה וויז'ן
	קנאשור		טקטונה
	שמיים		ספרינג
			נוסטרומו
			קונטיניואל
			סייפ-טי גרופ

מניות שיכנסו למדד אם תחול עליה קלה במחירן הן: טכנ גילוי אש גז, סטורג' דרופ, אנדימד

מדד טק עילית

שינויים בממד תק עילית אם העדכון היה מתבסס על נתוני ה 23.12

נכנסות		יוצאות	
מניה	הערה	מניה	הערה
האב		תיגי	ערך שוק
סיפיה וויז'ן		קבסיר	ערך שוק
טקטונה			
ספרינג			
נוסטרומו			
שרין טכנו			
טראקנט			
ביומיט פוד יהש			
שלוש 3 דיאם			

מניות שיכנסו לממד אם תחול עליה קלה במחירן הן: טכנ גילוי אש גז

מדד תא טכנולוגיה

שינויים בממד תא טכנולוגיה אם העדכון היה מתבסס על נתוני ה 23.12

נכנסות		יוצאות	
מניה	הערה	מניה	הערה
האב		פיט השקעות יהש	
טורבוג'ן		איידנטי	
סיפיה וויז'ן		שמיים	
טקטונה			
ספרינג			
נוסטרומו			
קונטיניואל			
סייפ-טי גרופ			

מניות שיכנסו לממד אם תחול עליה קלה במחירן הן: טכנ גילוי אש גז, סטורג' דרופ

מדד קלינטק

שינויים בממד קלינטק אם העדכון היה מתבסס על נתוני ה 23.12

נכנסות		יוצאות	
מניה	הערה	מניה	הערה
טורבוג'ן			
נוסטרומו			

מניות שיכנסו לממד אם תחול עליה קלה במחירן הן: סטורג' דרופ

מדד ביומד

שינויים בממד ביומד אם העדכון היה מתבסס על נתוני ה 23.12

נכנסות		יוצאות	
מניה	הערה	מניה	הערה
		פארמוקן	
		קנאשור	

מניות שיכנסו לממד אם תחול עליה קלה במחירן הן: אנדימד

שינויים במדד סקטור באלאנס אם העדכון היה מתבסס על נתוני ה 23.12

נכנסות		יוצאות	
מניה	הערה	מניה	הערה
ריטיילורס		פריגו	
ורדיס		בראק אן וי	
נאייקס		אוגווינד	
אלקטרה נדלן		אלומיי	
תורפז		אלוט	
פרשקובסקי		גילת	
מספנות ישראל		ראדא	גבולית
דלתא מותגים			

אילקס מדיקל וטרמינל איקס יתמודדו על מקום במדד אם תהיה עליה במחירן. מנגד, באטמ ונובולוג בסיכון ליציאה מהמדד אם תהיה ירידה במחירן.

שינויים במדד תל דיב אם העדכון היה מתבסס על נתוני ה 23.12

נכנסות		יוצאות	
מניה	הערה	מניה	הערה
פועלים		מליסרון	
מזרחי		ביג	
הראל השקעות		מיטרוניקס	
מנורה מבטחים		דלק קבוצה	
סנו		בז"ן	
יוחננוף		אינרום	
אלטשולר שחם גמל			
לוינשטיין נכסים			
דוניץ			
פרירטק			
לוינשטיין הנדסה			
פלרם			
טיב טעם			
מיטב דש	גבולית		
טלסיס			
מור השקעות	גבולית		
נורסטאר			
צמח המרמן			
תמר פטרוליום			

מניית אמת תגהס למדד אם ערך שוק של החזקות ציבור יהיה מעל ל 400 מיליון ש"ח.