

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

סימולציה של עדכון הרכב מדדים פברואר 2022, נכון ל 16.12, תחת ההנחות הבאות:

1 – מיזוג פרשמרקט לתוך פז נפט יושלם לפני המועד הקובע לעדכון.

2 – עסקת מכירת מניות המוסדיים בבראק אן וי תושלם עד ל 31.12.

אם אחת משתי ההנחות לא תממש, תמנע כניסת המניה האחרונה למדדי תא-90 | 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 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 16.12

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

קנון מדורגת 30, דלק קידוחים 31. הפער ביניהן קטן. זאת שתדורג במקום הגבוה יותר תכנס למדד. השניה תכנס רק אם גם היא תדורג 30 ומעלה, או שהמניה הקטנה במדד תדורג 40 ומטה. אנלייט מדורגת 34 וללא הנפקה גדולה או זינוק חד במניה היא לא תכנס למדד.

בתחתית אנרג'יקס מדורגת 38, אופיסי 37. אם ירדו לדרוג ה 40 ומטה יצאו. המדורגת נמוך מביניהן תצא גם אם 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. המועד הקובע לפיו נבחן שיעור החזקות הציבור בחברה הוא ה 31.12. מניית **בראק אן וי** דווחה על רכישת מניות של מוסדיים ע"י LEG, אך עסקה זו תלויה בתנאים מתלים. אם העסקה תושלם עד ל 31.12 מניית בראק אן וי תצא מהמדדים המובילים. המודל מניח ששתי מניות אלו לא יכללו 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 16.12

יוצאות			נכנסות		
הערה	מניה	דרוג	הערה	מניה	דרוג
מעבר ל 35	קנון	-		פרשקובסקי	50
תלוי בהשלמת עסקה	בראק אן וי	-		תורפז	53
	ג'נסל	125		אורמד	70
	אקוואריוס מנוע	119		אילקס מדיקל	71
	קומפיוגן	112		פולירם	75
	אוגווינד	108	גבולית	נאוויטס פטר יהש	79
	אפולו פאוור	107	גבולית	סקופ	80
	אלומיי	105			
	בונוס	104			
גבולית	קרור	99			
גבולית	גילת	98			

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. נאוויטס וסקופ גבוליות ביותר מבחינת הכניסה למדד. גם למניות: אאורה (דרוג 81), ויתניה (דרוג 84), דוניץ (דרוג 87) וחג'ג' (דרוג 90) יש סיכוי להיכנס למדד.

כמות היוצאות מהמדד תלויה בכמות המניות שיכנסו. בסבירות רבה ג'נסל, אקוואריוס מנועים, קומפיוגן, אוגווינד, אפולו פאוור, אלומיי ובונוס יצאו מהמדד. אם העדכון היה נערך לפי נתוני ה 16.12 גם קרור וגילת היו יוצאות מהמדד. מניות נוספות בסיכון הן: ראדא, אלוט, ג'נריישן ונייר חדרה. 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 16.12

יוצאות			נכנסות		
הערה	מניה	דרוג	הערה	מניה	דרוג
	מעבר ל 90	-		גילת	8
	מעבר ל 90	-		קרור	9
	מעבר ל 90	-		בונוס	14
	מעבר ל 90	-		אלומיי	15
	מעבר ל 90	-		אפולו	17
	מעבר ל 90	-		אוגווינד	18
	החזקות ציבור	-		קומפיוג'ן	22
	פמס	108		שירותי בנק אוטו	28
	על בד	97		אקוואריוס מנוע	29
	אנלייבקס	92		ג'נסל	35
	פורסייט	82	גבולית	חנן מור	39
	ספאנטק	75	גבולית	טופ גאם	40
	גלוברנדס	72	גבולית, מסלול מהיר	אייקון גרופ	*48
	רבל	70			
	מניף	67			
	פינרג'י	66			
	כפרית	66			
	גבולית	65			
	פּוּרפּליט	65			

הכניסה של חנן מור, טופ גאם ואייקון גרופ בגולית. מעט מאחור בוליגו (דרוג 43) וקיסטון ריט (דרוג 45) יתמודדו גם הן על כניסה למדד אם ישפרו את הדרוג שלהן.

בצד היוצאות צפויה תחרות צמודה, כאשר גם אספן גרופ, בית שמש, משק אנרגיה ופנינסולה 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 16.12

יוצאות		נכנסות	
הערה	מניה	הערה	מניה
מעבר לתא-125	פרשקובסקי	מעבר מ sme60	פמס
מעבר ל sme60	שירותי בנק אוטו	מעבר מ sme60	על בד
מעבר ל sme60	חנן מור	מעבר מ sme60	אנלייבוקס
מעבר ל sme60	טופ גאם	מעבר מ sme60	פורסייט
	ג'י.פי גלובל	מעבר מ sme60	ספאנטק
	פיט השקעות יהש	מעבר מ sme60	גלוברנדס
	איידנטי	מעבר מ sme60	רבל
	פארמוקן	מעבר מ sme60	מניף
	קנאשור	מעבר מ sme60	פינרג'י
	שמיים	מעבר מ sme60	כפרית
	אינטליקנה	מעבר מ sme60	פאורפליט
גבולית	קנבוטק		ארנה גרופ
גבולית	ברם תעשיות		הכשרה התחדשות האב
		מסלול מהיר	טורבוג'ן
		מסלול מהיר	סיפיה וויז'ן
			טקטונה
			ספרינג
			נוסטרומו
		גבולית	טכנ גילוי אש גז
		גבולית	סטורג' דרופ
		גבולית	פרידנזון
		מסלול מהיר	קונטיניואל
			סייפ-טי גרופ

מדדים נוספים:

מדד נדל"ן

שינויים במדד נדל"ן אם העדכון היה מתבסס על נתוני ה 16.12

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 16.12

יוצאות		נכנסות	
הערה	מניה	הערה	מניה
			ארנה גרופ

מדד בניה

שינויים במדד בניה אם העדכון היה מתבסס על נתוני ה 16.12

יוצאות		נכנסות	
הערה	מניה	הערה	מניה
			הכשרה התחדשות

מדד גלובל בלוטק

שינויים במדד גלובל בלוטק אם העדכון היה מתבסס על נתוני ה 16.12

יוצאות		נכנסות	
הערה	מניה	הערה	מניה
	פיט השקעות יהש		האב
	איידנטי		טורבוג'ן
	פארמוקן		סיפיה וויז'ן
	קנאשור		טקטונה
	שמיים		ספרינג
	אינטליקנה		נוסטרומו
גבולית	קנבוטק	גבולית	טכנ גילוי אש גז
		גבולית	סטורג' דרופ
			קונטיניואל
			סייפ-טי גרופ

מדד טק עילית

שינויים בממד תק עילית אם העדכון היה מתבסס על נתוני ה 16.12

יוצאות		נכנסות	
הערה	מניה	הערה	מניה
ערך שוק	תיגי		האב
ערך שוק	קבסיר		סיפיה וויז'ן
			טקטונה
			ספרינג
			נוסטרומו
		גבולית	טכנ גילוי אש גז
			שרין טכנו
			טראקנט
		גבולית	ביומיט פוד יהש

מדד תא טכנולוגיה

שינויים בממד תא טכנולוגיה אם העדכון היה מתבסס על נתוני ה 16.12

יוצאות		נכנסות	
הערה	מניה	הערה	מניה
	פיט השקעות יהש		האב
	איידנטי		טורבוג'ן
	שמיים		סיפיה וויז'ן
			טקטונה
			ספרינג
			נוסטרומו
		גבולית	טכנ גילוי אש גז
		גבולית	סטורג' דרופ
			קונטיניואל
			סייפ-טי גרופ

מדד קלינטק

שינויים בממד קלינטק אם העדכון היה מתבסס על נתוני ה 16.12

יוצאות		נכנסות	
הערה	מניה	הערה	מניה
			טורבוג'ן
			נוסטרומו
		גבולית	סטורג' דרופ

מדד ביומד

שינויים במדד ביומד אם העדכון היה מתבסס על נתוני ה 16.12

יוצאות		נכנסות	
הערה	מניה	הערה	מניה
	פארמוקן		
	קנאשור		
	אינטליקנה		
גבולית	קנבוטק		