

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

סימולציה של עדכון הרכב מדדים פברואר 2022, נכון ל 30.12. פרשמרקט תמוזג לתוך פז השבוע, ותמחק מהמדד עוד השבוע. סופרין, אלומה ופיימנט יכנסו למדדים כבר ב 6.1 במסגרת המסלול המהיר.

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 30.12

יוצאות			נכנסות		
הערה	מניה	דרוג	הערה	מניה	דרוג
לקראת מחיקה ממסחר	פריגו	-		קבון	28

מניית קבון תכנס כמעט בודאות למדד (ותחליף אף פריגו שתצא מהמדד).

כניסה של מניה שניה למדד תדרוש את אחד משני התנאים: אותה מניה תדורג 30 ומעלה מבין המניות העונות לתנאי המדד או שמניה מתוך המדד תדורג 40 ותצא ממנו (ואז המניה עם הדירוג הגבוה ביותר תכנס למדד ללא קשר לדירוג עצמו).

דלק קידוחים ופוקס מדורגות במקומות ה 31 ו 32. אך ערך השוק שלהן נמוך בכ 8% מהמניה המדורגת 30 (אלקטרה), ולכן הסיכוי שידורגו 30 ומעלה נמוך.

בתחתית אנרג'יקס מדורגת 39 בפער של כ 3% מהמניות בדרוג 40 (קמטק) ו 41 (אלקו). אם המניה תרד לדרוג ה 40 ומטה היא תצא מהמדד, ואז תהיה תחרות צמודה בין דלק קידוחים ופוקס על המקום שיתפנה במדד (אנלייט תתחרה גם היא רק אם תבצע הנפקת מניות מהותית).

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 וכמות המניות תפחת ל 94. 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 30.12

יוצאות			נכנסות		
הערה	מניה	דרוג	הערה	מניה	דרוג
מעבר ל 35	קנון	-		פרשקובסקי	52
תלוי בהשלמת עסקה	בראק אן וי	-		תורפז	53
	אקוואריוס מנוע	130		אילקס מדיקל	71
	אפולו פאוור	128		פולירם	72
	אוגווינד	126		אאורה	74
	ג'נסל	121	גבולית	נאוויטס	78
	קומפיוג'ן	111			
	אלומיי	109			
	קרור	101			
	גילת	100			

הכניסה של פרשקובסקי, תורפז, אילקס מדיקל, פולירם ואאורה למדד כמעט ודאית. נאוויטס בדרוג ה 78 ממנו נכנסים למדד, והיא תכנס למדד אם תשמור על הדרוג. אורמד (מדורגת 81), אך בזכות פער ארביטראז חיובי צפויה לעלות ביום ראשון לדרוג ה 78, ולכן גם היא מצויה עדיין בתחרות על מקום אפשרי במדד. וויתניה (מדורגת 82) קרובה גם היא לסף ממנו נכנסים למדד. הכניסה האפשרית למדד של נאוויטס, אורמד וויתניה תקבע לפי המסחר במניות אלו בשבועיים הקרובים.

כמות היוצאות מהמדד תלויה בכמות המניות שיכנסו. בסבירות רבה ג'נסל, אקוואריוס מנועים, קומפיוג'ן, אוגווינד, אפולו פאוור, אלומיי, קרור וגילת. כניסה אפשרית של אורמד או ויתניה למדד תוציא ממנו גם את מניית אלוט. המניות: ג'נריישן ודיפלומט ונמצאות בסיכון נמוך ליציאה מהמדד.

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 30.12

יוצאות			נכנסות		
הערה	מניה	דרוג	הערה	מניה	דרוג
	מעבר ל 90	-		גילת	10
	מעבר ל 90	-		קרור	11
	מעבר ל 90	-		שירותי בנק אוטו	17
	מעבר ל 90	-		אלומיי	19
	מעבר ל 90	-		קומפיוג'ן	21
	החזקות ציבור	-		חנן מור	31
	פמס	111		ג'נסל	32
	אנלייבקס	110	גבולית	אוגווינד	36
	על בד	99	גבולית	אפולו פאוור	38
	פורסייט	85	גבולית	אקוואריוס מנוע	40
	ספאנטק	76	גבולית, מסלול מהיר	אייקון גרופ	50
	פאוורפליט	73			
	גלוברנדס	72			
	רב	71			
	מניף	68			
	בית שמש	68	גבולית		

גם מניות שיוצאות ממדד תא-90 צריכות לעמוד בתנאי הכניסה למדד (דרוג 40) כדי להיכנס אליו. נכון לסוף השבוע כל 8 המניות שצפויות לצאת ממדד תא-90 עמדו בתנאי זה, אך העמידה של אפולו פאוור, אקוואריוס מנועים ואוגווינד – גבולית, ואם תהיה ירידה במחירן הן עלולות לצאת ישירות ממדד תא-90 למדד צמיחה ולא להיקלט במדד sme60. בנוסף, מניות שב"א וחנן מור צפויות להיכנס למדד. מניית אייקון גרופ מתמודדת על כניסה למדד במסגרת המסלול המהיר. בסוף השבוע דורגה במקום ה 50, שהוא המקום האחרון ממנו נכנסים למדד. אם תשמור על דרוג זה תכנס למדד ואם תרד בדרוג המניה תסתפק בכניסה למדד צמיחה. מעט מאחור נמצאת מניית בוליו (דרוג 42) שתכנס למדד אם מחירה יעלה.

כמות היוצאות מהמדד תהיה תלויה בכמות הנכנסות. בשלב זה מסתמן ש 9 המניות עם ערך השוק הקובע הנמוך ביותר יצאו מהמדד, אך מספר זה יכול להשתנות.

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 30.12

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
	ג'.פי גלובל	מעבר מ sme60	אנלייבקס
	פיט השקעות יהש	מעבר מ sme60	פורסייט
	פארמוקן	מעבר מ sme60	ספאנטק
	שמיים	מעבר מ sme60	גלוברנדס
	איידנטי	מעבר מ sme60	פּוּרפּליט
	קנאשור	מעבר מ sme60	רבל
	אינטליקנה	מעבר מ sme60	מניף
		מעבר מ sme60	בית שמש
			ארנה גרופ
			הכשרה התחדשות
			האב
		מסלול מהיר	טורבוג'ן
		מסלול מהיר	סיפיה וויז'ן
			טקטונה
			ספרינג
			נוסטרומו
		מסלול מהיר	קונטיניואל
			סייפ-טי גרופ

מניות שיכנסו למדד אם תחול עליה קלה במחירן הן: פרידנזון, אנדימד, כאשר אם הבורסה תחליט שמניית לוזון נדל"ן כשירה להיכנס למדדים גם היא תתמודד על מקום במדד.

מדדים נוספים:

מדד נדל"ן

שינויים במדד נדל"ן אם העדכון היה מתבסס על נתוני ה 30.12

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 30.12

יוצאות		נכנסות	
הערה	מניה	הערה	מניה
			ארנה גרופ

מדד בניה

שינויים במדד בניה אם העדכון היה מתבסס על נתוני ה 30.12

יוצאות		נכנסות	
הערה	מניה	הערה	מניה
			הכשרה התחדשות

מדד גלובל בלוטק

שינויים במדד גלובל בלוטק אם העדכון היה מתבסס על נתוני ה 30.12

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

מניות שיכנסו למדד אם תחול עליה קלה במחירן הן: אנדימד

מדד טק עילית

שינויים בממד תק עילית אם העדכון היה מתבסס על נתוני ה 30.12

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

מדד תא טכנולוגיה

שינויים בממד תא טכנולוגיה אם העדכון היה מתבסס על נתוני ה 30.12

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

מדד קלינטק

שינויים בממד קלינטק אם העדכון היה מתבסס על נתוני ה 30.12

יוצאות		נכנסות	
הערה	מניה	הערה	מניה
			טורבוג'ן
			נוסטרומו

מדד ביומד

שינויים בממד ביומד אם העדכון היה מתבסס על נתוני ה 30.12

יוצאות		נכנסות	
הערה	מניה	הערה	מניה
	פארמוקן		
	קנאשור		
	אינטליקנה		

מניות שיכנסו לממד אם תחול עליה קלה במחירן הן: אנדימד

שינויים במדד סקטור באלאנס אם העדכון היה מתבסס על נתוני ה 30.12

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

אילקס מדיקל תתמודדו על מקום במדד אם תהיה עליה במחירה. מנגד, באטמ בסיכון ליציאה מהמדד אם אילקס תכנס אליו.

שינויים במדד תל דיב אם העדכון היה מתבסס על נתוני ה 30.12

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			
טלסיס			
מור השקעות	גבולית		
נורסטאר			
צמח המרמן			
תמר פטרוליום			
אמת			