

מדריך מעו"ף

מדדי מניות

מדדי מניות

תוכן עניינים

מדד ת"א ALL-SHARE

מדד ת"א-MIDCAP150

מדד ת"א-צמיחה

מדד ת"א גלובל-בלוטק

מדד ת"א טק-עילית

מדד ת"א-טכנולוגיה

מדד ת"א-ביומד

מדד ת"א-פיננסים

מדד ת"א-ביטוח ושירותים פיננסים

מדד ת"א-נדל"ן

מדד ת"א-נפט וגז

מדד ת"א-תקשורת וטכנולוגיות מידע

מדד תל-דיב

מדד ת"א-מעלה

מדד ת"א-35 דולר

מדד ת"א-סקטור באלאנס

מדד ת"א-תעשייה

מדד ת"א-פמילי

מדד ת"א-תשתיות אנרגיה

מדד ת"א-בנייה

מדד ת"א-מניב ישראל

מדד ת"א-מניב חו"ל

מדד ת"א-קלינטק

מדד ת"א-125 אקלים נקי מדלקים פוסיליים

מדד ת"א-קנאביס

מדד ת"א-דואליות

מדד ת"א-ביטוח

מדד ת"א-רשתות שיווק

מדד ת"א-TOPNEW30

מדד ת"א-בנקים

מדד ת"א-EW 125

מדדי מניות תוכן עניינים

עמוד	שם פרק
1 - ו	מדד ת"א All-Share
2 - ו	מדד ת"א-MidCap150
3 - ו	מדד ת"א-צמיחה
5 - ו	מדד ת"א גלובל-בלוטק
6 - ו	מדד ת"א טק-עילית
8 - ו	מדד ת"א-טכנולוגיה
9 - ו	מדד ת"א-ביומד
10 - ו	מדד ת"א-פיננסים
11 - ו	מדד ת"א-ביטוח ושירותים פיננסים
12 - ו	מדד ת"א-נדל"ן
13 - ו	מדד ת"א-נפט וגז
15 - ו	מדד ת"א-תקשורת וטכנולוגיות מידע
16 - ו	מדד תל-דיב
17 - ו	מדד ת"א-מעלה
18 - ו	מדד ת"א-35 דולר
20 - ו	מדד ת"א-סקטור באלאנס
21 - ו	מדד ת"א-תעשייה
22 - ו	מדד ת"א-פמילי
23 - ו	מדד ת"א-תשתיות אנרגיה
24 - ו	מדד ת"א-בנייה
25 - ו	מדד ת"א-מניב ישראל
26 - ו	מדד ת"א-מניב חו"ל
27 - ו	מדד ת"א-קלינטק
28 - ו	מדד ת"א-125 אקלים נקי מדלקים פוסיליים
29 - ו	מדד ת"א-קנאביס
30 - ו	מדד ת"א-דואליות
31 - ו	מדד ת"א-ביטוח
32 - ו	מדד ת"א-רשתות שיווק
33 - ו	מדד ת"א-TopNew 30
34 - ו	מדד ת"א-בנקים
35 - ו	מדד ת"א-EW125

מדד ת"א All-Share

1. מדד ת"א All-Share (להלן: "המדד") הינו מדד בסדרת מדדי תמר.
2. במועד עדכון המדד תיכלל בו כל מניה אשר במועד הקובע לעדכונו, יתקיימו לגביה התנאים המצטברים הבאים (להלן: "תנאי הסף"):
 - א. נקבע כי תיכלל בתמר.
 - ב. המניה הינה מניה ישראלית או הינה מניה זרה הכלולה במדד.
3. על אף האמור לעיל, צורפה מניה ישראלית לתמר במסגרת המסלול המהיר, תיווסף המניה למדד במועד צירופה לתמר.
4. ועדת מדדים תקבע את מגבלת המשקל של מניה במדד ובלבד שלא תעלה על 10%¹
5. המדד יחושב לפי נוסחת מדד תשואה כוללת ברוטו.
6. מועד השקת המדד - 1.7.2010.
7. מדד הבסיס של המדד ביום השקתו הינו כמפורט להלן:

מדד ת"א All-Share הושק תחילה כמדד ת"א-כללי בתאריך 1.7.2010 לפי בסיס 990.34 (זהה למדד ת"א-100 בסוף יום 30.6.2010) ומאוחר יותר מותג כת"א-מאגר. שם המדד שונה לת"א-AllShare בתום יום המסחר בתאריך 9.2.2017."

¹ ועדת מדדים החליטה כי תקרת המשקל של המדד תהיה 0.5%.

מדד ת"א-Midcap150

1. מדד ת"א-Midcap150 (להלן: "המדד") הינו מדד בסדרת מדדי תמר.
 2. במדד ת"א-Midcap150 יכללו מניות אשר במועד הקובע לעדכון התמר נקבע כי יכללו במדד ת"א-90, כמפורט בנספח 4 בפרק א' בהנחיות על פי החלק השביעי לתקנון, או במדד ת"א-SME60, וזאת במועד עדכון המדד הקרוב.
 3. בכל מועד עדכון מדד, יגרעו מהמדד המניות אשר נקבע כי במועד עדכון המדד הן לא ייכללו במדד ת"א-90 או במדד ת"א-SME60, וייוספו למדד מניות אשר נקבע כי במועד עדכון המדד הן ייוספו למדד ת"א-90 או למדד ת"א-SME60.
 4. על אף האמור לעיל, צורפה מניה לרימון במועד שאינו מועד עדכון ההרימון, תיווסף המניה למדד במועד צירופה לרימון, אם המניה תיווסף למדד ת"א-90 או במדד ת"א-SME60.
 - כתוצאה מצירוף המניה כאמור, לא תיגרע מניה אחרת מהמדד עד למועד עדכון המדד הבא.
 5. ועדת מדדים תקבע את מגבלת המשקל של מניה במדד ובלבד שלא תעלה על 10%¹.
 6. המדד יחושב לפי נוסחת מדד תשואה כוללת ברוטו.
 7. מועד השקת המדד 7 במאי 2017.
 8. מדד הבסיס של המדד ביום השקתו זהה למדד הבסיס של מדד ת"א-90, במועד ההשקה.
- מדד ת"א-MidCap150 הושק כמדד ת"א-SME150 לפי תקרת משקל אחיד ושונה בתאריך 2.11.2023 לת"א-Midcap150 לפי תקרת משקל 2%.

¹ ועדת מדדים החליטה כי מגבלת המשקל של המדד תהיה לפי 2%. תקרת המשקל הורחבה ממשקל אחיד ל-2% ב-2/11/2023.

מדד ת"א-צמיחה

1. מדד ת"א-צמיחה (להלן: "המדד") הינו מדד בסדרת מדדי תמר.
2. במועד עדכון המדד תיכלל בו כל מניה אשר במועד הקובע לעדכוננו, יתקיימו לגביה התנאים המצטברים הבאים (להלן: "תנאי הסף"):
 - א. נקבע כי תיכלל בתמר.
 - ב. נקבע כי לא תיכלל במדד ת"א-125 או במדד ת"א-SME60.
 - ג. המניה הינה מניה ישראלית או הינה מניה זרה הכלולה במדד.
3. בכל מועד עדכון מדד, יגרעו מהמדד המניות אשר אינן עומדות בתנאי הסף של המדד וייוספו למדד מניות שעומדות בתנאי הסף של המדד.
4. מנגנון השלמת מניות למדד

א. לאחר הרכבת המדד, בהתאם לאמור בסעיפים 2. ו-3. לעיל, תבדוק הבורסה האם המדד מקיים את התנאים הקבועים בס"ק 1 (2-ו) להלן:

(1) במועד הקובע לעדכון המדד יחול האמור להלן:

- (א) המשקל המצרפי של כל המניות אשר השווי הממוצע של החזקות הציבור שלהן נמוך מ-75 מיליון ש"ח- יהיה נמוך מ-25%.
- (ב) השווי הממוצע המצרפי של החזקות הציבור של כל המניות הנכללות במדד יהיה לפחות 5 מיליארד ש"ח.

(2) שווי החזקות הציבור הממוצע המצרפי של כל המניות הנכללות במדד במועד הקובע לעדכון המדד יהיה לפחות 5 מיליארד ש"ח לפי הנוסחה להלן:

$$S_t = S_{NonCap} / (1 - W_{Cap})$$

מונחים הגדרות

- S_t - השווי הממוצע של החזקות הציבור של כל המניות הנכללות במדד
- S_{NonCap} - השווי הממוצע של החזקות הציבור של כל המניות שמשקלן נמוך ממגבלת המשקל
- W_{Cap} - המשקל המצרפי של כל המניות שמשקלן במדד נקבע לפי מגבלת המשקל.

ב. היה ולא התקיימו שני התנאים המפורטים בסעיפים 1 (2-ו) לעיל, תיווסף למדד המניה הישראלית אשר השווי הממוצע של החזקות הציבור שלה הינו הנמוך ביותר מבין המניות הנכללות במדד ת"א-SME60 אשר השווי הממוצע של החזקות הציבור שלהן הוא לפחות 75 מיליון ש"ח (להלן: "מנגנון ההשלמה").

היה ועדיין לא התקיימו שני התנאים המפורטים בסעיפים 1 (2-ו) לעיל, יחול מנגנון ההשלמה פעם נוספת וחוזר חלילה, עד אשר יתקיים אחד מהתנאים האמורים בסעיף 1 או 2 לעיל.

5. בוטל.

6. תקרת המשקל

- א. ועדת מדדים תקבע את מגבלת המשקל של מניה במדד ובלבד שלא תעלה על 10%¹.
 - ב. על אף האמור בסעיף א. לעיל, במועד עדכון המדד הראשון לגביו יחול סעיף זה (להלן: "המועד הראשון"), תקרת המשקל של מניה הנכללת ברשימת המועמדות לדלי סחירות תהיה 0.2%. ועדת מדדים רשאית להגדיל את תקרת המשקל של המניה במועדי עדכון פרמטרים שיחולו לאחר המועד הראשון עד לתקרת המשקל שקבעה במדד.
7. המדד יחושב לפי נוסחת מדד תשואה כוללת ברוטו.
 8. מועד השקת המדד - 1.4.2007
 9. מדד הבסיס של מדד ת"א-צמיחה הינו כמפורט להלן:

מדד ת"א-צמיחה הושק תחילה כמדד יתר-120 בתאריך 1.4.2007 לפי בסיס 1,086.88 (זהה למדד יתר-150 בסוף יום 29.03.2007). המדד הורחב מ-120 מניות לכל המניות הנכללות במאגר, שאינן נכללות במדד ת"א-100, בתאריך 1.7.2010 ושמו שונה למדד יתר-ת"א ומאוחר יותר מותג בשם ת"א יתר-מאגר. שם המדד שונה לת"א-צמיחה בתום יום המסחר בתאריך 9.2.2017.

¹ ועדת מדדים החליטה כי תקרת המשקל של המדד תהיה 2%.

מדד ת"א גלובל-בלוטק

1. מדד ת"א גלובל-בלוטק (להלן: "המדד") הינו מדד בסדרת מדדי תמר.
2. במועד עדכון המדד תיכלל בו כל מניה אשר במועד הקובע לעדכוננו, יתקיימו לגביה התנאים המצטברים הבאים (להלן: "תנאי הסף"):
 - א. נקבע כי תיכלל בתמר.
 - ב. נקבע כי תיכלל ברשימת מניות בלוטק.

לענין מדד זה -
3. "רשימת מניות בלוטק" - רשימה הכוללת מניות אשר לפי הסיווג הענפי של הבורסה כלולות בענף "טכנולוגיה" (מספר ענף 88/00) או בענף "ביומד" (מספר ענף 87/00).
4. בכל מועד עדכון מדד, יגרעו מהמדד המניות אשר אינן עומדות בתנאי הסף של המדד וייוספו למדד מניות שעומדות בתנאי הסף של המדד.
5. על אף האמור לעיל, צורפה מניה לתמר במועד שאינו מועד עדכון התמר, תיוסף המניה למדד במועד צירופה לתמר, אם המניה תיוסף למדד ת"א-טכנולוגיה או למדד ת"א-ביומד.
6. ועדת מדדים תקבע את מגבלת המשקל של מניה במדד ובלבד שלא תעלה על 10%¹.
7. המדד יחושב לפי נוסחת מדד תשואה כוללת ברוטו.
8. מועד השקת המדד - 3.1.1999.
9. מדד הבסיס של מדד ת"א גלובל-בלוטק הינו כמפורט להלן:

מדד ת"א גלובל-בלוטק הושק תחילה כמדד תל-טק בתאריך 3.1.1999 לפי בסיס 212.61 (זוהה למדד הבסיס של מדד חברות האלקטרוניקה באותו יום) ושונה לת"א בלוטק-50 בתאריך 3.4.2011 לפי בסיס הזוהה למדד תל-טק בסוף יום 31.3.2011. מדד ת"א בלוטק-50 שונה למדד ת"א-בלוטק בתאריך 15.6.2014. שם המדד שונה בתום המסחר בתאריך 9.2.2017 לת"א גלובל-בלוטק.

¹ ועדת מדדים החליטה כי תקרת המשקל של המדד תהיה 2%.

מדד ת"א טק-עילית

1. מדד ת"א טק-עילית (להלן: "המדד") הינו מדד בסדרת מדדי תמר.
2. במועד עדכון המדד תיכלל בו כל מניה אשר במועד הקובע לעדכון, יתקיימו לגביה התנאים המצטברים הבאים (להלן: "תנאי הסף"):
 - א. נקבע כי תיכלל בתמר.
 - ב. המניה הינה מניה ישראלית.
 - ג. (1) שווי השוק הממוצע של מניה וותיקה הנכללת במדד יהיה 75 מיליון ש"ח לפחות.
 - (2) שווי השוק הממוצע של מניה וותיקה שאינה נכללת במדד יהיה 150 מיליון ש"ח לפחות.
 - ד. נקבע כי המניות יכללו ברשימת מניות טק-עילית.

לענין מדד זה -

"רשימת מניות טק-עילית" – רשימה הכוללת מניות אשר לפי הסיווג הענפי של הבורסה כלולות באחד מהענפים או תתי ענפים שלהלן: ענף "טכנולוגיה" (מספר ענף 88/00) תת-ענף ביוטכנולוגיה בענף ביומד (מספר תת-ענף 87/01), תת-ענף מכשור רפואי בענף ביומד (מספר תת-ענף 87/02) ותת-ענף השקעות במדעי החיים בענף ביומד (מספר תת-ענף 87/03).
3. בכל מועד עדכון מדד, יגרעו מהמדד המניות אשר אינן עומדות בתנאי הסף של המדד וייוספו למדד מניות שעומדות בתנאי הסף של המדד.
4. צירוף מניה חדשה למדד

פרסמה חברה המיועדת להיכלל ברשימת מניות טק-עילית תשקיף - תיווסף המניה שתונפק על ידי החברה למדד במועד עדכון הפרמטרים הקרוב, אם היא תעמוד בתנאים המצטברים שלהלן ובלבד שנרשמה למסחר עד המועד הקובע של עדכון הפרמטרים כאמור.

 - (1) החברה הגישה בקשה לצרף את מניותיה למדד והצהירה כי היא עומדת בכל התנאים המפורטים בס"ק (2) עד 6.
 - (2) המניה הינה מניה ישראלית.
 - (3) הבורסה קבעה כי המניה תיכלל ברשימת מניות טק-עילית.
 - (4) המחיר המזערי של המניה בתשקיף לא יפחת מ-50 אגורות.
 - (5) שווי השוק המזערי שנקבע בתשקיף לא יפחת מ-100 מיליון ש"ח.
 - (6) שווי החזקות הציבור המזערי שנקבע בתשקיף לא יפחת מ-50 מיליון ₪.
 - (7) שיעור החזקות הציבור הצפוי במניה לא יפחת מ-10%.
 - (8) המניה אינה רשומה למסחר בבורסה נוספת.

צורפה המניה למדד ת"א טק-עילית כאמור לעיל, תיווסף המניה גם למאגר תמר ולמדדים הרלוונטיים במועד צירופה למדד ת"א טק-עילית.

לענין ס"ק זה -

"המחיר המזערי של המניה בתשקיף" - המחיר המזערי שנקבע למניה בתשקיף, וכאשר המניה הוצעה במסגרת יחידת הנפקה - מחיר יחידת ההנפקה בתשקיף בניכוי ערכם של כתבי האופציה ואופציות הרכישה הכלולים בה, בהתאם לנוסחאות החישוב כמשמעותן בהגדרה "מחיר אפקטיבי של מניה" בחלק השני לתקנון הבורסה.

מדריך מעו"ף-עדכון מס' 133 מעודכן עד ליום 2/11/2023 - 274765

"שווי השוק המזערי" - המחיר המזערי של המניה בתשקיף מוכפל בהון שהחברה מבקשת לרשום למסחר.

"שווי החזקות הציבור המזערי" - שווי השוק המזערי מוכפל בשיעור החזקות הציבור הצפוי של המניה.

5. ועדת מדדים תקבע את מגבלת המשקל של מניה במדד ובלבד שלא תעלה על 10%¹

6. המדד יחושב לפי נוסחת מדד תשואה כוללת ברוטו.

7. מועד השקת המדד - 11 במאי, 2014.

8. מדד הבסיס של המדד ביום השקתו - 320.77 (זהה למדד הבסיס של מדד ת"א בלוטק-50 ביום 11 במאי, 2014).

¹ ועדת מדדים החליטה כי תקרת המשקל של המדד תהיה 5%.

מדד ת"א-טכנולוגיה

1. מדד ת"א-טכנולוגיה (להלן: "המדד") הינו מדד בסדרת מדדי תמר.
2. במועד עדכון המדד תיכלל בו כל מניה אשר במועד הקובע לעדכוננו, יתקיימו לגביה התנאים המצטברים הבאים (להלן: "תנאי הסף"):
 - א. נקבע כי תיכלל בתמר.
 - ב. נקבע כי תיכלל ברשימת מניות טכנולוגיה.
 - לענין מדד זה -
 - ג. המניה הינה מניה ישראלית.
3. בכל מועד עדכון מדד, יגרעו מהמדד המניות אשר אינן עומדות בתנאי הסף של המדד וייוספו למדד מניות שעומדות בתנאי הסף של המדד.
4. על אף האמור לעיל, צורפה מניה ישראלית לתמר במועד שאינו מועד עדכון התמר, תיווסף המניה למדד במועד צירופה לתמר, אם במועד הקובע לעדכון הפרמטרים נכללת המניה ברשימת מניות הטכנולוגיה.
5. ועדת מדדים תקבע את מגבלת המשקל של מניה במדד ובלבד שלא תעלה על 10%¹.
6. המדד יחושב לפי נוסחת מדד תשואה כוללת ברוטו.
7. מועד השקת המדד - 3.4.2011.
8. מדד הבסיס של המדד ביום השקתו - 292.04 (זהה למדד הנעילה של מדד תל-טק בסוף יום 31.3.2011).

¹ ועדת מדדים החליטה כי תקרת המשקל של המדד תהיה 10%. תקרת המשקל הורחבה מ-5% ל-10% ב-2/11/2023.

מדד ת"א-ביומד

1. מדד ת"א-ביומד (להלן: "המדד") הינו מדד בסדרת מדדי תמר.
2. במועד עדכון המדד תיכלל בו כל מניה אשר במועד הקובע לעדכוננו, יתקיימו לגביה התנאים המצטברים הבאים (להלן: "תנאי הסף"):
 - א. נקבע כי תיכלל בתמר.
 - ב. נקבע כי תיכלל ברשימת מניות ביומד.
 - לעניין מדד זה -
- ג. המניה הינה מניה ישראלית או הינה מניה זרה הכלולה במדד.
3. בכל מועד עדכון מדד, יגרעו מהמדד המניות אשר אינן עומדות בתנאי הסף של המדד וייוספו למדד מניות שעומדות בתנאי הסף של המדד.
4. על אף האמור לעיל, צורפה מניה ישראלית לתמר במועד שאינו מועד עדכון התמר, תיווסף המניה למדד במועד צירופה לתמר, אם במועד הקובע לעדכון הפרמטרים נכללת המניה ברשימת מניות ביומד.
5. ועדת מדדים תקבע את מגבלת המשקל של מניה במדד ובלבד שלא תעלה על 10%¹
6. המדד יחושב לפי נוסחת מדד תשואה כוללת ברוטו.
7. מועד השקת המדד - 2.3.2010
8. מדד הבסיס של המדד ביום השקתו - 1116.10 (זהה למדד הבסיס של מדד ת"א-100 באותו יום).

¹ ועדת מדדים החליטה כי תקרת המשקל של המדד תהיה 10%.

מדד ת"א-פיננסים

1. מדד ת"א-פיננסים (להלן: "המדד") הינו מדד בסדרת מדדי תמר.
2. במועד עדכון המדד תיכלל בו כל מניה אשר במועד הקובע לעדכון, יתקיימו לגביה התנאים המצטברים הבאים (להלן: "תנאי הסף"):
 - א. נקבע כי תיכלל בתמר.
 - ב. נקבע כי תיכלל ברשימת מניות פיננסים.
 - לעניין מדד זה -
 - ג. המניה הינה מניה ישראלית.
3. בכל מועד עדכון מדד, יגרעו מהמדד המניות אשר אינן עומדות בתנאי הסף של המדד וייוספו למדד מניות שעומדות בתנאי הסף של המדד.
4. על אף האמור לעיל, צורפה מניה ישראלית לתמר במועד שאינו מועד עדכון התמר, תיווסף המניה למדד במועד צירופה לתמר, אם במועד הקובע לעדכון הפרמטרים המניה נכללת ברשימת מניות הפיננסים.
5. ועדת מדדים תקבע את מגבלת המשקל של מניה במדד ובלבד שלא תעלה על 15%¹.
6. המדד יחושב לפי נוסחת מדד תשואה כוללת ברוטו.
7. מועד השקת המדד - 2.1.2005.
8. מדד הבסיס של מדד ת"א-פיננסים הינו כמפורט להלן:

מדד ת"א-פיננסים הושק תחילה כמדד פיננסים-15 בתאריך 2.1.2005 לפי בסיס 814.18 (זהה למדד ת"א-בנקים בסוף יום 31.12.2004) והורחב מ-15 מניות לכל מניות העומדות בתנאי הסף של המדד, בתאריך 1.7.2010, לפי בסיס 1029.15 (זהה למדד פיננסים-15 בסוף יום 30.6.2010).

¹ ועדת מדדים החליטה כי תקרת המשקל של המדד תהיה 10%.

מדד ת"א-ביטוח ושירותים פיננסיים

1. מדד ת"א-ביטוח ושירותים פיננסיים (להלן: "המדד") הינו מדד בסדרת מדדי תמר.
2. במועד עדכון המדד תיכלל בו כל מניה אשר במועד הקובע לעדכוננו, יתקיימו לגביה התנאים המצטברים הבאים (להלן: "תנאי הסף"):
 - א. נקבע כי תיכלל בתמר.
 - ב. נקבע כי תיכלל ברשימת מניות ביטוח ושירותים פיננסיים.
 - לענין מדד זה -
 - ג. "רשימת מניות ביטוח ושירותים פיננסיים" - רשימה הכוללת מניות אשר לפי הסיווג הענפי של הבורסה כלולות בענף ביטוח (מספר ענף - 93/00), בתת-ענף "שירותים פיננסיים" (מספר תת-ענף - 84/01) ובתת ענף אשראי חוץ בנקאי (מספר תת-ענף - 84/02).
 - המניה הינה מניה ישראלית.
3. בכל מועד עדכון מדד, יגרעו מהמדד המניות אשר אינן עומדות בתנאי הסף של המדד ויווספו למדד מניות שעומדות בתנאי הסף של המדד.
4. על אף האמור לעיל, צורפה מניה ישראלית לתמר במועד שאינו מועד עדכון התמר, תיוסף המניה למדד במועד צירופה לתמר, אם במועד הקובע לעדכון הפרמטרים נכללת המניה ברשימת מניות ביטוח ושירותים פיננסיים.
5. ועדת מדדים תקבע את מגבלת המשקל של מניה במדד ובלבד שלא תעלה על 20%¹
6. המדד יחושב לפי נוסחת מדד תשואה כוללת ברוטו.
7. מועד השקת המדד - 3.4.2011.
8. מדד הבסיס של המדד הינו כמפורט להלן:

מדד ת"א-ביטוח ושירותים פיננסיים הושק תחילה כמדד ת"א-ביטוח בתאריך 3.4.2011 לפי בסיס 1571.58 (זהה למדד הבסיס של מדד חברות הביטוח באותו יום). המדד הורחב ממניות הנכללות בענף הביטוח למניות הנכללות בענף הביטוח וענף שירותים פיננסיים ושמו שונה למדד ת"א ביטוח-פלוס בתום יום המסחר ב-9.2.2017. מדד הבסיס של מדד ת"א ביטוח-פלוס בתאריך 12.2.2017 זהה למדד הנעילה של ת"א-ביטוח בסוף יום 9.2.2017. ב-1.7.2021 שונה שם המדד למדד ת"א-ביטוח ושירותים פיננסיים.

מדד ת"א-נדל"ן

1. מדד ת"א-נדל"ן (להלן: "המדד") הינו מדד בסדרת מדדי תמר.
2. במועד עדכון המדד תיכלל בו כל מניה אשר במועד הקובע לעדכוננו, יתקיימו לגביה התנאים המצטברים הבאים (להלן: "תנאי הסף"):
 - א. נקבע כי תיכלל בתמר.
 - ב. נקבע כי תיכלל ברשימת הנדל"ן.
 - לעניין מדד זה -
 - ג. "רשימת הנדל"ן" - רשימה הכוללת מניות אשר לפי הסיווג הענפי של הבורסה כלולות בענף "נדל"ן ובינו" (מספר ענף - 95/00).
 - המניה הינה מניה ישראלית.
3. בכל מועד עדכון מדד, יגרעו מהמדד המניות אשר אינן עומדות בתנאי הסף של המדד וייוספו למדד מניות שעומדות בתנאי הסף של המדד.
4. על אף האמור לעיל, צורפה מניה ישראלית לתמר במועד עדכון פרמטרים שאינו מועד עדכון התמר, תיווסף המניה למדד במועד צירופה לתמר, אם במועד הקובע לעדכון הפרמטרים נכללת המניה ברשימת הנדל"ן.
5. ועדת מדדים תקבע את מגבלת המשקל של מניה במדד ובלבד שלא תעלה על 15%¹.
6. המדד יחושב לפי נוסחת מדד תשואה כוללת ברוטו.
7. מועד השקת המדד - 2.1.2005.
8. מדד הבסיס של המדד הינו כמפורט להלן:

מדד ת"א-נדל"ן הושק תחילה כמדד נדל"ן-15 בתאריך 2.1.2005 לפי בסיס 278.80 (זהה למדד נדל"ן ובינוי בסוף יום 31.12.2004). המדד הורחב מ-15 מניות לכל מניות העומדות בתנאי הסף של המדד בתום יום המסחר ב-9.2.2017. מדד הבסיס של מדד ת"א-נדל"ן בתאריך 12.2.2017 זהה למדד הנעילה של ת"א נדל"ן-15 בסוף יום 9.2.2017. תקרת המשקל הורחבה ל-5% ב-2/11/2023.

¹ ועדת מדדים החליטה כי תקרת המשקל של המדד תהיה 5%. תקרת המשקל הורחבה מ-3% ל-5% ב-2/11/2023.

מדד ת"א-נפט וגז

1. מדד ת"א-נפט וגז (להלן: "המדד") הינו מדד בסדרת מדדי תמר.
2. במועד עדכון המדד תיכלל בו כל מניה אשר במועד הקובע לעדכוננו, יתקיימו לגביה התנאים המצטברים הבאים (להלן: "תנאי הסף"):
 - א. נקבע כי תיכלל בתמר.
 - ב. נקבע כי תיכלל ברשימת מניות חיפושי נפט וגז.
 - לענין מדד זה -
 - "רשימת מניות חיפושי נפט וגז" - רשימה הכוללת מניות אשר לפי הסיווג הענפי של הבורסה כלולות בתת-ענף "חיפושי נפט וגז" (מספר תת-ענף - 98/01) וכל המניות מרשימת מניות האנרגיה, כמפורט להלן, הנכללות במדד במועד הקובע לעדכון המדד.
 - "רשימת מניות האנרגיה" - רשימה שוועדת מדדים רשאית לקבוע מבין המניות אשר לפי הסיווג הענפי של הבורסה כלולות בתת-ענף "אנרגיה" (מספר תת-ענף - 98/03).
 - ג. המניה הינה מניה ישראלית.
 3. בכל מועד עדכון מדד, יגרעו מהמדד המניות אשר אינן עומדות בתנאי הסף של המדד וייוספו למדד מניות שעומדות בתנאי הסף של המדד.
 4. מנגנון השלמת מניות למדד
 - לאחר הרכבת המדד, בהתאם לאמור לעיל, תבדוק הבורסה האם המדד מקיים את שני התנאים המפורטים בסעיפים א. ו-ב. להלן:
 - א. תנאי שווי ממוצע מצרפי של החזקות הציבור במדד
 - (1) חלקן של 2 המניות הגדולות נמוך מ-50%
 - אם השווי הממוצע המצרפי של החזקות הציבור של 2 המניות בעלות השווי הממוצע של החזקות הציבור הגדול ביותר במדד (להלן: "שתי הגדולות"), נמוך ממחצית השווי הממוצע המצרפי של החזקות הציבור של כל המניות הנכללות במדד. תבדוק הבורסה כי השווי הממוצע המצרפי של החזקות הציבור של כל המניות הנכללות במדד, גבוה מ-5 מיליארד ש"ח.
 - (2) חלקן של 2 המניות הגדולות הוא 50% או יותר
 - אם השווי הממוצע המצרפי של החזקות הציבור שתי הגדולות, שווה או גדול ממחצית השווי הממוצע המצרפי של החזקות הציבור של כל המניות הנכללות במדד, תבדוק הבורסה כי השווי הממוצע המצרפי של החזקות הציבור של כל המניות הנכללות במדד בניכוי שתי הגדולות, גבוה מ-5 מיליארד ש"ח.
 - ב. במדד נכללות לפחות 10 מניות.

היה ולא מתקיים אחד מהתנאים המפורטים בסעיפים א. ו-ב. לעיל, ועדת מדדים רשאית להוסיף למדד את כל המניות הישראליות מרשימת מניות האנרגיה הנכללות בתמר.

מדריך מעו"ף-עדכון מס' 67 מעודכן עד ליום 9.2.17 - 274768

5. על אף האמור לעיל, צורפה מניה ישראלית לתמר במועד שאינו מועד עדכון התמר, תיוסף המניה למדד במועד צירופה לתמר, אם במועד הקובע לעדכון הפרמטרים נכללת המניה ברשימת מניות חיפושי נפט וגז.
6. ועדת מדדים תקבע את מגבלת המשקל של מניה במדד ובלבד שלא תעלה על 15%¹
7. המדד יחושב לפי נוסחת מדד תשואה כוללת ברוטו.
8. מועד השקת המדד - 3.4.2011.
9. מדד הבסיס של המדד ביום השקתו - 1388.74 (זהה למדד הבסיס של מדד חברות חיפושי הנפט והגז באותו יום).

¹ ועדת מדדים החליטה כי תקרת המשקל של המדד תהיה 15%.

מדד ת"א-תקשורת וטכנולוגיות מידע

1. מדד ת"א תקשורת וטכנולוגיות מידע (להלן: "המדד") הינו מדד בסדרת מדדי תמר.
2. במועד עדכון המדד תיכלל בו כל מניה אשר במועד הקובע לעדכון, יתקיימו לגביה התנאים המצטברים הבאים (להלן: "תנאי הסף"):
 - א. נקבע כי תיכלל בתמר.
 - ב. נקבע כי תיכלל ברשימת מניות תקשורת וטכנולוגיות מידע.

לענין מדד זה -

"רשימת מניות תקשורת וטכנולוגיות מידע" - רשימה הכוללת מניות אשר לפי הסיווג הענפי של הבורסה כלולות בתת-ענף "תקשורת ומדיה" (מספר תת ענף - 94/06) אשר בענף "מסחר ושירותים" (מספר ענף 94), תת-ענף "שירותי מידע" (מספר ענף - 88/01) אשר בענף "טכנולוגיה" (מספר ענף 88) ותת-ענף "ציוד תקשורת" (מספר ענף - 88/05) אשר בענף "טכנולוגיה" (מספר ענף 88).
 - ג. המניה ישראלית.
3. בכל מועד עדכון מדד, יגרעו מהמדד המניות אשר אינן עומדות בתנאי הסף של המדד ויווספו למדד מניות שעומדות בתנאי הסף של המדד.
4. על אף האמור לעיל, צורפה מניה ישראלית לתמר במועד שאינו מועד עדכון התמר, תיווסף המניה למדד במועד צירופה לתמר, אם במועד הקובע לעדכון הפרמטרים נכללת המניה ברשימת מניות תקשורת וטכנולוגיות מידע.
5. ועדת מדדים תקבע את מגבלת המשקל של מניה במדד ובלבד שלא תעלה על 15%¹
6. המדד יחושב לפי נוסחת מדד תשואה כוללת ברוטו.
7. מועד השקת המדד - 3.4.2011.
8. מדד הבסיס של המדד הינו כמפורט להלן:

מדד ת"א-תקשורת וטכנולוגיות מידע הושק תחילה כמדד ת"א-תקשורת בתאריך 3.4.2011 לפי בסיס 1200.43 (זהה למדד הבסיס של ת"א-מאגר באותו יום). המדד הורחב ממניות הנכללות בתת-ענף תקשורת ומדיה למניות הנכללות בתת-ענף תקשורת ומדיה, תת-ענף שירותי מידע ותת-ענף ציוד תקשורת בתום יום המסחר ב-9.2.2017. מדד הבסיס של מדד ת"א-תקשורת וטכנולוגיות מידע בתאריך 9.2.2017 זהה למדד הנעילה של ת"א-תקשורת בסוף יום 9.2.2017.

¹ ועדת מדדים החליטה כי תקרת המשקל של המדד תהיה 10%.

מדד תל-דיב

1. מדד תל-דיב (להלן: "המדד") הינו מדד בסדרת מדדי תמר. "תשואת הדיבידנד השנתית" לענין מדד זה, תחושב כמפורט בנוסחה להלן:

$$Y = \sum_{i=1}^n \frac{d_i}{P_i}$$

- | מונחים | הגדרות |
|--------|---|
| Y | - תשואת הדיבידנד השנתית של המניה. |
| d_i | - דיבידנד ברוטו i באגורות, אשר שולם לבעלי המניות באמצעות מסלקת הבורסה. |
| P_i | - שער הנעילה של המניה ביום הקובע לתשלום הדיבידנד i . |
| n | - מספר הפעמים ששולם דיבידנד לבעלי המניות בין 1.1 ל-31.12 בשנה שקדמה למועד הקובע לעדכון המדד, כמשמעותו להלן. |
2. המדד יעודכן פעם אחת בשנה, במועד עדכון התמר בחודש מאי, בכל שנה (להלן: "מועד עדכון המדד"). המועד הקובע לעדכון המדד יהיה המועד הקובע לעדכון התמר בחודש מאי, בכל שנה (להלן: "המועד הקובע לעדכון המדד").
3. תנאי הסף למניות במדד תל-דיב הינם כלהלן:
- א. מניות אשר במועד הקובע לעדכון המדד נכללות בתמר.
 - ב. (1) השווי הממוצע של החזקות הציבור במניה הנכללת במדד במועד הקובע לעדכון המדד, יהיה 300 מיליון ש"ח לפחות.
 - (2) השווי הממוצע של החזקות הציבור במניה שאינה נכללת במדד במועד הקובע לעדכון המדד, יהיה 400 מיליון ש"ח לפחות.
 - ג. מניות שתשואת הדיבידנד השנתית שלהן היא לפחות 2% ב-2 מתוך 3 השנים שהסתיימו בתום יום 31.12 שקדם למועד הקובע לעדכון המדד.
 - ד. המניה הינה מניה ישראלית.
4. בכל מועד עדכון מדד יגרעו מהמדד המניות אשר אינן עומדות בתנאי הסף של המדד וייוספו למדד מניות שעומדות בתנאי הסף של המדד.
5. אין מסלול מהיר להצטרפות מניה למדד.
6. ועדת מדדים תקבע את מגבלת המשקל של מניה במדד ובלבד שלא תעלה על 10%¹.
7. המדד יחושב לפי נוסחת מדד תשואה כוללת ברוטו.
8. מועד השקת המדד - 2.7.2006.
9. מדד תל דיב הושק תחילה כמדד תל דיב-20 בתאריך 2.7.2006 לפי בסיס 793.57 (זהה למדד הבסיס של מדד ת"א-100 במועד זה) והורחב ביום 3.4.2011 מ-20 מניות לכל המניות העומדות בתנאי הסף של המדד, לפי בסיס הזהה למדד תל דיב-20 בסוף יום 31.3.2011.

¹ ועדת מדדים החליטה כי מגבלת המשקל של המדד תהיה לפי משקל אחיד.

מדד ת"א-מעלה

1. מדד ת"א-מעלה (להלן: "המדד") הינו מדד בסדרת מדדי תמר.
2. המדד יעודכן פעם אחת בשנה, במועד עדכון התמר בחודש נובמבר (להלן: "מועד עדכון המדד"). המועד הקובע לעדכון המדד יהיה המועד הקובע לעדכון התמר בחודש נובמבר, בכל שנה (להלן: "המועד הקובע לעדכון המדד").
3. תנאי הסף למניות במדד ת"א-מעלה הינם כלהלן:
 - א. מניות אשר במועד הקובע לעדכון המדד עומדות בתנאי הסף של התמר.
 - ב. מניות אשר במועד הקובע לעדכון המדד נכללות ברשימת מניות מעלה, כמשמעותה להלן.
לעניין מדד זה -
 - ג. המניה הינה מניה ישראלית.
4. בכל מועד עדכון מדד יגרעו מהמדד המניות אשר אינן עומדות בתנאי הסף של המדד וייוספו למדד מניות שעומדות בתנאי הסף של המדד.
5. אין מסלול מהיר להצטרפות מניה למדד.
6. ועדת מדדים תקבע את מגבלת המשקל של מניה במדד ובלבד שלא תעלה על 10%¹.
7. המדד יחושב לפי נוסחת מדד תשואה כוללת ברוטו.
8. מועד השקת המדד - 13.2.2005.
9. ערך מדד הבסיס של המדד ביום השקתו - 662.82 (זהה לערך מדד הבסיס של מדד ת"א-100 באותו יום).
10. מדד ת"א-מעלה הושק תחילה כמדד הכולל 20 מניות בלבד והורחב לכל מניות העומדות בתנאי הסף של המדד, בתאריך 1.7.2010.

¹ ועדת מדדים החליטה כי תקרת המשקל של המדד תהיה 5%.

מדד ת"א-35 דולר

1. מדד ת"א-35 דולר (להלן: "המדד") הינו מדד בסדרת מדדי תמר.
2. על המדד יחולו כל הכללים החלים על מדד ת"א-35, למעט אופן חישוב המדד.
3. יחושב מדד קובע בלבד בסוף כל יום מסחר, על פי שערי הנעילה של המניות הנכללות במדד, כמפורט להלן:

א. נוסחת חישוב המדד

$$I_c^t = I_c^{(t-1)} \times \left(\sum_{i=1}^n W_i^t \times \frac{p_{ic}^t}{p_{ib}^t} \right) \times \frac{Fx^{(t-1)}}{Fx^t}$$

ב. מרכיבי הנוסחאות

מונחים הגדרות

- I_c^t - מדד קובע ביום t.
- $I_c^{(t-1)}$ - מדד קובע ביום t-1.
- n - מספר המניות הנכללות במדד.
- i - מניה i.
- W_i^t - משקל מניה i במדד ביום t.
- P_{ic}^t - שער קובע של מניה i ביום t.
- P_{ib}^t - שער הבסיס של מניה i ביום t.
- Fx^t (1) בימים שני עד חמישי - שער דולר שפרסם בנק ישראל באותו יום.
- (2) ביום ראשון - שער דולר אמריקאי שפרסם בנק ישראל ביום שישי.
- $Fx^{(t-1)}$ - Fx_t ביום המסחר שקדם ליום t.

ג. חישוב המדד הקובע במקרים חריגים

על אף האמור לעיל, במקרים הבאים יחושב המדד הקובע כלהלן:

- (1) לא התקיים שלב מסחר נעילה או מסחר פתיחה נפרד, לפי העניין, במועד גריעת מניה ממדד בשל אחת העילות המפורטות בסעיף 2.א.6) בחלק הרביעי לתקנון הבורסה, יחושב המדד הקובע במועד גריעת המניה מהמדד, כאילו היה שער הנעילה של המניה שווה לאפס.
- (2) ביום בו תיגרע מניה ממדד בשל קיבול הצעת רכש כמפורט בס"ק 2.א.6) בפרק א' בחלק השביעי לתקנון הבורסה, ומחזיקי המניה מקבלים תמורתה מזומן בלבד שאינו מותנה בדבר, יחושב המדד הקובע כאילו היה שער הנעילה של המניה כאמור שווה לתמורת הצעת הרכש כמפורט בנוסחה בסעיף 4) להלן.
- (3) ביום בו תיגרע מניה מתמזגת ממדד בשל מיזוג כמפורט בס"ק 2.א.6) בפרק א' בחלק השביעי לתקנון הבורסה, ומחזיקי המניה מקבלים תמורתה מזומן בלבד שאינו מותנה בדבר, יחושב המדד הקובע כאילו היה שער הנעילה של המניה כאמור שווה לתמורת המיזוג כמפורט בנוסחה בסעיף 4) להלן.

(4) לעניין ס"ק 2 ו-3), יחושב המדד הקובע כאילו שער הנעילה של המניה היה כמפורט להלן:

$$P_T = C \times F_X$$

מונחים הגדרות

- P_T - שער הנעילה של המניה לצורך חישוב המדד, שיחושב באגורות.
- C - מזומן שמקבלים מחזיקי המניה בהצעת הרכש או מחזיקי המניה המתמזגת בגין כל מניה בהתאם לסוג המטבע הנקוב בתנאי המיזוג או הצעת הרכש, לפי העניין.
- F_X - שער החליפין היציג האחרון שפורסם, לפני מועד הגריעה, של המטבע אותו מקבלים מחזיקי המניה בהצעת הרכש או מחזיקי המניה המתמזגת.

4. מועד תחילת חישוב המדד - 4.1.2005.

5. מדד הבסיס של המדד ביום תחילת החישוב - 1,000.

מדד ת"א-35 דולר הושק תחילה כמדד ת"א-25 נטו דולר. המדד הורחב מ-25 מניות ל-35 מניות בתום יום המסחר ב-9.2.2017. מדד הבסיס של מדד ת"א-35 נטו דולר בתאריך 12.2.2017 זהה למדד הנעילה של ת"א-25 נטו דולר בסוף יום 9.2.2017. ביום 2.1.2022 שונה המדד למדד ת"א-35 נטו דולר המחושב לפי שער יציג של בנק ישראל.

ביום 6.2.2022 שונה המדד למדד ת"א-35 דולר.

מדד ת"א-סקטור באלאנס

1. מדד ת"א סקטור באלאנס (להלן: "המדד") הינו מדד בסדרת מדדי תמר.
2. במועד עדכון המדד תיכלל בו כל מניה וותיקה אשר במועד הקובע לעדכון, יתקיימו לגביה התנאים המצטברים הבאים (להלן: "תנאי הסף"):
 - א. נקבע כי תיכלל במדד ת"א-125 או במדד ת"א-SME60.
 - ב. המניה לא סווגה לפי הסיווג הענפי של הבורסה בענף השקעות ואחזקות (ענף 97).
 - ג. המניה לא סווגה לפי הסיווג הענפי של הבורסה בענף הביומד (ענף 87), למעט תת-ענף פארמה (תת-ענף 87/04).
 - ד. לא יכללו במדד יותר מ-15 מניות מכל תת-ענף לפי הסיווג הענפי של הבורסה. עמדו יותר מ-15 מניות מתת-ענף מסוים בתנאי הסף של המדד, יכללו במדד 15 המניות בעלות שווי השוק הממוצע הגבוה ביותר באותו תת-ענף.
- על אף האמור לעיל, במדד לא יכללו יותר מ-15 מניות הכלולות ברשימת מניות נדל"ן מניב. עמדו יותר מ-15 מניות מרשימת נדל"ן מניב בתנאי הסף של המדד, יכללו במדד 15 המניות בעלות שווי השוק הממוצע הגבוה ביותר מרשימת נדל"ן מניב.

לענין מדד זה -

"רשימת מניות נדל"ן מניב" - רשימה הכוללת מניות אשר לפי הסיווג הענפי של הבורסה כלולות בתת-ענף "נדל"ן מניב בחו"ל" (מספר תת-ענף - 95/06) או בתת-ענף "נדל"ן מניב בישראל" (מספר תת-ענף - 95/05).
- ה. המחזור היומי הממוצע של מניה לא יפחת מ-300 אלף ש"ח.
3. במדד יכללו 100 מניות אשר במועד הקובע לעדכון המדד יהיו בעלות שווי השוק הממוצע הגבוה ביותר מבין המניות העומדות בתנאי הסף של המדד, בכפוף לאמור בסעיפים 4 ו-5. להלן.
4. בכל מועד עדכון מדד, תעודכן רשימת המניות הכלולות במדד לפי השלבים המפורטים להלן:
 - א. במועד הקובע לעדכון המדד ידורגו המניות שעומדות בתנאי הסף של המדד על פי דירוג שווי שוק ממוצע.
 - ב. במועד עדכון המדד יגרעו מהמדד, הן המניות אשר אינן עומדות בתנאי הסף של המדד, והן המניות אשר דורגו על פי דירוג שווי שוק ממוצע בדירוג שווה ל-110 או נמוך ממנו וייוספו למדד מניות שדורגו על פי דירוג שווי שוק ממוצע בדירוג שווה ל-90 או גבוה ממנו.
 - ג. אם לאחר גריעת מניות מהמדד והוספת מניות למדד, כמפורט בסעיף 4.ב. לעיל, נכללות ברשימה יותר מ-100 מניות, יגרעו מהרשימה מניות נוספות, אשר דורגו על פי דירוג שווי שוק ממוצע בדירוג הנמוך ביותר מבין המניות שנכללו ברשימה על פי בסעיף 4.ב. לעיל, עד שברשימה יכללו 100 מניות.
 - ד. אם לאחר גריעת מניות מהמדד והוספת מניות למדד, כמפורט בסעיף 4.ב. לעיל, נכללות ברשימה פחות מ-100 מניות, תיוספנה למדד מניות אשר דורגו על פי דירוג שווי שוק ממוצע בדירוג הגבוה ביותר מבין המניות שלא נכללו ברשימה על פי סעיף 4 לעיל, עד שברשימה יכללו 100 מניות; 1.
5. אין מסלול מהיר להצטרפות מניה למדד.
6. ועדת מדדים תקבע את מגבלת המשקל של מניה במדד ובלבד שלא תעלה על 15%¹.
7. המדד יחושב לפי נוסחת מדד תשואה כוללת ברוטו.

¹ ועדת מדדים החליטה כי תקרת המשקל של מניה במדד תהיה 2% למניה שלא סווגה לפי הסיווג הענפי של הבורסה בענף הנדל"ן ולקבוע תקרת משקל של 1% למניה שסווגה לפי הסיווג הענפי של הבורסה בענף הנדל"ן.

8. מועד השקת המדד - 4.2.2018.

9. מדד הבסיס של המדד ביום השקתו יהיה זהה למדד הבסיס של מדד ת"א-125, באותו יום.

מדד ת"א-תעשייה

1. מדד ת"א-תעשייה (להלן: "המדד") הינו מדד בסדרת מדדי תמר.
2. במועד עדכון המדד תיכלל בו כל מניה אשר במועד הקובע לעדכון, יתקיימו לגביה התנאים המצטברים הבאים (להלן: "תנאי הסף"):
 - א. נקבע כי תיכלל בתמר.
 - ב. המניה הינה מניה ישראלית.
 - ג. נקבע כי תיכלל ברשימת מניות התעשייה.

לעניין מדד זה -

"רשימת מניות התעשייה" - רשימה הכוללת מניות אשר לפי הסיווג הענפי של הבורסה כלולות באחד מהענפים או תתי ענפים שלהלן: ענף תעשייה (מספר ענף 96), תת-ענף אלקטרוניקה אופטיקה שבענף הטכנולוגיה (מספר תת-ענף 88/03), תת-ענף ביטחוניות שבענף הטכנולוגיה (מספר תת-ענף 88/04), תת-ענף ציוד תקשורת שבענף הטכנולוגיה (מספר תת-ענף 88/05), תת-ענף מוליכים למחצה שבענף הטכנולוגיה (מספר תת-ענף 88/06), תת-ענף קלינטק שבענף הטכנולוגיה (מספר תת-ענף 88/08), תת-ענף רובטיקה ותלת מימד שבענף הטכנולוגיה (88/10), תת-ענף אנרגיה מתחדשת שבענף הטכנולוגיה (מספר 88/11), תת-ענף ביוטכנולוגיה שבענף הביומד (מספר תת-ענף 87/01), תת-ענף מכשור רפואי שבענף הביומד (מספר תת-ענף 87/02) ותת-ענף פארמה שבענף הביומד (מספר תת-ענף 87/04).
 - ד. על מנת להיכלל ברשימת מניות התעשייה שווי שוק ממוצע של מניה הנכללת באחד מתתי-הענפים שלהלן לא יפחת מ:

אם המניה מסווגת בתת-ענף ביוטכנולוגיה שבענף הביומד (מספר תת-ענף 87/01) שווי שוק ממוצע שלה לא יפחת מ-500 מיליון ש"ח.

אם המניה מסווגת בתת-ענף מכשור רפואי שבענף הביומד (מספר תת-ענף 87/02) שווי שוק ממוצע שלה לא יפחת מ-500 מיליון ש"ח.

אם המניה מסווגת בתת-ענף קלינטק שבענף הטכנולוגיה (מספר תת-ענף 88/08) שווי שוק ממוצע שלה לא יפחת מ-1,500 מיליון ש"ח.

אם המניה מסווגת בתת-ענף אנרגיה מתחדשת שבענף הטכנולוגיה (מספר תת-ענף 88/11) שווי שוק ממוצע שלה לא יפחת מ-1,500 מיליון ש"ח.
3. בכל מועד עדכון מדד, יגרעו מהמדד המניות אשר אינן עומדות בתנאי הסף של המדד ויווספו למדד מניות שעומדות בתנאי הסף של המדד.
4. על אף האמור לעיל, צורפה מניה ישראלית לתמר במועד שאינו מועד עדכון התמר, תיווסף המניה למדד במועד צירופה לתמר, אם במועד הקובע לעדכון הפרמטרים נכללת המניה ברשימת מניות התעשייה.
5. ועדת מדדים תקבע את מגבלת המשקל של מניה במדד ובלבד שלא תעלה על 10%¹.
6. המדד יחושב לפי נוסחת מדד תשואה כוללת ברוטו.
7. מועד השקת המדד - 25.4.2018.
8. מדד הבסיס של המדד ביום השקתו יהיה זהה למדד הבסיס של מדד ת"א-125, באותו יום.

¹ ועדת מדדים החליטה כי תקרת המשקל של מניה במדד תהיה 3% למניה.

מדד ת"א-פמילי

1. מדד ת"א-פמילי (להלן: "המדד") הינו מדד בסדרת מדדי תמר.
2. המדד יעודכן פעם אחת בשנה, במועד עדכון הרימון בחודש נובמבר (להלן: "מועד עדכון המדד"). המועד הקובע לעדכון המדד יהיה המועד הקובע לעדכון הרימון בחודש נובמבר, בכל שנה (להלן: "המועד הקובע לעדכון המדד").
3. תנאי הסף למניות במדד ת"א-פמילי הינם כלהלן:
 - א. החברה שהנפיקה את המניה נכללת ברשימת החברות המשפחתיות. לעניין מדד זה -
 - "רשימת החברות המשפחתיות" - רשימה הכוללת חברות אשר ב-30 ביוני 2023 והחל משנת 2024 - ב-31 באוגוסט מתקיימים בהן שני התנאים המצטברים הבאים¹:
 - החברה הנמצאת בשליטת בני משפחה² אחת או יותר המחזיקים לפחות 25% בהון החברה. לעניין זה - "שליטה" ו-"החזקה" כמשמעותם בחוק ניירות ערך.
 - בהתאם לדיווחי החברה, בחברה מכהנים לפחות שלושה בני משפחה בנושא משרה בכירה, כמשמעות המונח בחוק ניירות ערך.
 - ב. מניה אשר במועד הקובע לעדכון המדד עומדת בתנאי הסף של הרימון.
 - ג. המניה הינה מניה ישראלית.
 - ד.
 - 1) שווי השוק הממוצע של המניה הנכללת במדד במועד הקובע לעדכון המדד, יהיה 300 מיליון ש"ח לפחות.
 - 2) שווי השוק הממוצע של המניה שאינה נכללת במדד במועד הקובע לעדכון המדד, יהיה 400 מיליון ש"ח לפחות.
 - ה. על אף האמור לעיל, במועד הקובע הראשון לקביעת הרכב המדד שווי השוק הממוצע של המניה לא יפחת מ-300 מיליון ש"ח.
 - לא יכללו במדד יותר מ-10 מניות מכל תת-ענף לפי הסיווג הענפי של הבורסה. צפויות להיכלל במדד יותר מ-10 מניות מתת-ענף מסוים, במדד יכללו 10 המניות בעלות שווי השוק הממוצע הגבוה ביותר באותו תת-ענף.
 - על אף האמור לעיל, במדד לא יכללו יותר מ-10 מניות הכלולות ברשימת מניות נדל"ן מניב. עמדו יותר מ-10 מניות מרשימת נדל"ן מניב בתנאי הסף של המדד, יכללו במדד 10 המניות בעלות שווי השוק הממוצע הגבוה ביותר מרשימת נדל"ן מניב.

¹ בדיקת עמידת החברות בתנאים שנקבעו כאמור תעשה על ידי יחידת המחקר במחלקה הכלכלית של הבורסה.

² בן משפחה כמשמעות המונח בחוק ניירות ערך וכן אחיין, דוד, בן דוד, גיס, או בן משפחה אחר של כל אחד מאלה. בן משפחה ייספר פעמיים כאשר הוא מכהן כדירקטור ובנוסף מכהן בקביעות בנושא משרה בכירה אחרת

על אף האמור לעיל, קיימות פחות מ-25 מניות שעומדות בתנאי הסף של המדד, לא יחול סעיף זה.

4. בכל מועד עדכון מדד, יגרעו מהמדד המניות אשר אינן עומדות בתנאי הסף של המדד וייוספו למדד מניות שעומדות בתנאי הסף של המדד.
5. אין מסלול מהיר להצטרפות מניה למדד.
6. ועדת מדדים תקבע את מגבלת המשקל של מניה במדד ובלבד שלא תעלה על 10%¹.
7. המדד יחושב לפי נוסחת מדד תשואה כוללת ברוטו.
8. מועד השקת המדד - 14.10.2018.
9. מדד הבסיס של המדד ביום השקתו יהיה זהה למדד הבסיס של מדד ת"א-125, באותו יום.

¹ ועדת מדדים החליטה כי תקרת המשקל של מניה במדד תהיה 7% למניה.

מדד ת"א-תשתיות אנרגיה

1. מדד ת"א-תשתיות אנרגיה (להלן: "המדד") הינו מדד בסדרת מדדי תמר.
2. במועד עדכון המדד תיכלל בו כל מניה אשר במועד הקובע לעדכוננו, יתקיימו לגביה התנאים המצטברים הבאים (להלן: "תנאי הסף"):
 - א. נקבע כי תיכלל בתמר.
 - ב. נקבע כי תיכלל ברשימת מניות תשתיות אנרגיה.

לענין מדד זה -

"רשימת מניות תשתיות אנרגיה" - רשימה הכוללת מניות אשר לפי הסיווג הענפי של הבורסה כלולות בתת ענף אנרגיה (מספר ענף - 98/03), תת-ענף אנרגיה מתחדשת שבענף הטכנולוגיה (מספר 88/11) ובתת ענף קלינטק שבענף הטכנולוגיה (מספר ענף - 88/08).

ג. המניה הינה מניה ישראלית.
3. בכל מועד עדכון מדד, יגרעו מהמדד המניות אשר אינן עומדות בתנאי הסף של המדד וייוספו למדד מניות שעומדות בתנאי הסף של המדד.
4. על אף האמור לעיל, צורפה מניה ישראלית לתמר במועד שאינו מועד עדכון התמר, תיווסף המניה למדד במועד צירופה לתמר, אם במועד הקובע לעדכון הפרמטרים נכללת המניה ברשימת מניות תשתיות אנרגיה.
5. ועדת מדדים תקבע את מגבלת המשקל של מניה במדד ובלבד שלא תעלה על 20%¹.
6. המדד יחושב לפי נוסחת מדד תשואה כוללת ברוטו.
7. מועד השקת המדד – 1 ביולי, 2019.
8. מדד הבסיס של המדד ביום השקתו יהיה זהה למדד הבסיס של מדד ת"א-125, באותו יום.

¹ ועדת מדדים החליטה כי תקרת המשקל של מניה במדד תהיה 15%.

מדד ת"א-בנייה

1. מדד ת"א-בנייה (להלן: "המדד") הינו מדד בסדרת מדדי תמר.
2. במועד עדכון המדד תיכלל בו כל מניה אשר במועד הקובע לעדכוננו, יתקיימו לגביה התנאים המצטברים הבאים (להלן: "תנאי הסף"):
 - א. נקבע כי תיכלל בתמר.
 - ב. המניה הינה מניה ישראלית.
 - ג. נקבע כי תיכלל ברשימת מניות נדל"ן בנייה.

לענין מדד זה -

"רשימת מניות נדל"ן בנייה" - רשימה הכוללת מניות אשר לפי הסיווג הענפי של הבורסה כלולות בתת ענף "נדל"ן בנייה" (מספר ענף - 95004).
3. בכל מועד עדכון מדד, יגרעו מהמדד המניות אשר אינן עומדות בתנאי הסף של המדד וייוספו למדד מניות שעומדות בתנאי הסף של המדד.
4. על אף האמור לעיל, צורפה מניה ישראלית לתמר במועד שאינו מועד עדכון התמר, תיווסף המניה למדד במועד צירופה לתמר, אם במועד הקובע לעדכון הפרמטרים נכללת המניה ברשימת נדל"ן בנייה.
5. ועדת מדדים תקבע את מגבלת המשקל של מניה במדד ובלבד שלא תעלה על 20%¹.
6. המדד יחושב לפי נוסחת מדד תשואה כוללת ברוטו.
7. מועד השקת המדד – 9 בפברואר, 2020.
8. מדד הבסיס של המדד ביום השקתו יהיה זהה למדד הבסיס של מדד ת"א-נדל"ן, באותו יום.

¹ ועדת מדדים החליטה תקרת המשקל של מניה במדד תהיה 10%. תקרת המשקל הורחבה מ-5% ל-10% ב-2/11/2023.

מדד ת"א-מניב ישראל

1. מדד ת"א-מניב ישראל (להלן: "המדד") הינו מדד בסדרת מדדי תמר.
2. במועד עדכון המדד תיכלל בו כל מניה אשר במועד הקובע לעדכוננו, יתקיימו לגביה התנאים המצטברים הבאים (להלן: "תנאי הסף"):
 - א. נקבע כי תיכלל בתמר.
 - ב. המניה הינה מניה ישראלית.
 - ג. נקבע כי תיכלל ברשימת מניות נדל"ן מניב ישראל.

לענין מדד זה -

"רשימת מניות נדל"ן מניב ישראל" - רשימה הכוללת מניות אשר לפי הסיווג הענפי של הבורסה כלולות בתת ענף "נדל"ן מניב בישראל" (מספר תת-ענף - 95005).
3. בכל מועד עדכון מדד, יגרעו מהמדד המניות אשר אינן עומדות בתנאי הסף של המדד וייוספו למדד מניות שעומדות בתנאי הסף של המדד.
4. על אף האמור לעיל, צורפה מניה לתמר במועד שאינו מועד עדכון התמר, תיוסף המניה למדד במועד צירופה לתמר, אם במועד הקובע לעדכון הפרמטרים נכללת המניה ברשימת נדל"ן מניב ישראל.
5. ועדת מדדים תקבע את מגבלת המשקל של מניה במדד ובלבד שלא תעלה על 20%¹
6. המדד יחושב לפי נוסחת מדד תשואה כוללת ברוטו.
7. מועד השקת המדד – 9 בפברואר, 2020.
8. מדד הבסיס של המדד ביום השקתו יהיה זהה למדד הבסיס של מדד ת"א-נדל"ן, באותו יום.

¹ ועדת מדדים החליטה כי תקרת המשקל של מניה במדד תהיה 5%.

מדד ת"א-מניב חו"ל

1. מדד ת"א-מניב חו"ל (להלן: "המדד") הינו מדד בסדרת מדדי תמר.
2. במועד עדכון המדד תיכלל בו כל מניה אשר במועד הקובע לעדכוננו, יתקיימו לגביה התנאים המצטברים הבאים (להלן: "תנאי הסף"):
 - א. נקבע כי תיכלל בתמר.
 - ב. נקבע כי תיכלל ברשימת מניות נדל"ן מניב חו"ל.

לענין מדד זה -

"רשימת מניות נדל"ן מניב חו"ל" - רשימה הכוללת מניות אשר לפי הסיווג הענפי של הבורסה כלולות בתת ענף "נדל"ן מניב בחו"ל" (מספר ענף - 95006).
3. בכל מועד עדכון מדד, יגרעו מהמדד המניות אשר אינן עומדות בתנאי הסף של המדד וייוספו למדד מניות שעומדות בתנאי הסף של המדד.
4. על אף האמור לעיל, צורפה מניה לתמר במועד שאינו מועד עדכון התמר, תיווסף המניה למדד במועד צירופה לתמר, אם במועד הקובע לעדכון הפרמטרים נכללת המניה ברשימת נדל"ן מניב חו"ל.
5. ועדת מדדים תקבע את מגבלת המשקל של מניה במדד ובלבד שלא תעלה על 20%¹
6. המדד יחושב לפי נוסחת מדד תשואה כוללת ברוטו.
7. מועד השקת המדד – 9 בפברואר, 2020.
8. מדד הבסיס של המדד ביום השקתו יהיה זהה למדד הבסיס של מדד ת"א-נדל"ן, באותו יום.

¹ ועדת מדדים החליטה כי תקרת המשקל של מניה במדד תהיה 10%.

מדד ת"א-קלינטק

1. מדד ת"א-קלינטק (להלן: "המדד") הינו מדד בסדרת מדדי תמר.
2. במועד עדכון המדד תיכלל בו כל מניה אשר במועד הקובע לעדכוננו, יתקיימו לגביה התנאים המצטברים הבאים (להלן: "תנאי הסף"):
 - א. נקבע כי תיכלל בתמר.
 - ב. המניה הינה מניה ישראלית.
 - ג. נקבע כי תיכלל ברשימת מניות קלינטק.

לעניין מדד זה -

"רשימת מניות קלינטק" - רשימה הכוללת מניות אשר לפי הסיווג הענפי של הבורסה הן כלולות בתת-ענף קלינטק שבענף הטכנולוגיה (מספר תת-ענף – 88/08) ובתת-ענף אנרגיה מתחדשת שבענף הטכנולוגיה (מספר 88/11).
3. בכל מועד עדכון מדד, יגרעו מהמדד המניות אשר אינן עומדות בתנאי הסף של המדד וייוספו למדד מניות שעומדות בתנאי הסף של המדד.
4. על אף האמור לעיל, צורפה מניה לתמר במועד שאינו מועד עדכון התמר, תיווסף המניה למדד במועד צירופה לתמר, אם במועד הקובע לעדכון הפרמטרים נכללת המניה ברשימת קלינטק.
5. ועדת מדדים תקבע את מגבלת המשקל של מניה במדד ובלבד שלא תעלה על 20%¹
6. המדד יחושב לפי נוסחת מדד תשואה כוללת ברוטו.
7. מועד השקת המדד - 8 בנובמבר, 2020.
8. מדד הבסיס של המדד ביום השקתו יהיה זהה למדד הבסיס של מדד ת"א-טכנולוגיה, באותו יום.

¹ ועדת מדדים החליטה כי תקרת המשקל של מניה במדד תהיה 10%.

מדד ת"א-125 אקלים נקי מדלקים פוסיליים

1. מדד ת"א-125 אקלים נקי מדלקים פוסיליים (להלן: "המדד") הינו מדד בסדרת מדדי תמר.
2. המדד יעודכן פעם אחת בשנה, במועד עדכון התמר בחודש נובמבר (להלן: "מועד עדכון המדד"). המועד הקובע לעדכון המדד יהיה המועד הקובע לעדכון התמר בחודש נובמבר, בכל שנה (להלן: "המועד הקובע לעדכון המדד").
3. תנאי הסף למניות במדד ת"א-125 אקלים נקי מדלקים פוסיליים הם כלהלן:
 - א. מניה אשר במועד הקובע לעדכון המדד נקבע כי תיכלל במדד ת"א-125 במועד עדכון המדד.
 - ב. החברה שהנפיקה את המניה אינה נכללת ב"רשימת התאגידים הפוסיליים" במועד הקובע לעדכון המדד.

לעניין מדד זה -

"רשימת התאגידים הפוסיליים" - רשימה, הנערכת על ידי עמותת חיים וסביבה (להלן: "העמותה") והכוללת את כל התאגידים שמניותיהם נסחרות בבורסה ואשר הוגדרו על ידי העמותה כעוסקים בתחום הדלקים הפוסיליים.

הרשימה כפי שתעדכן עד 30 ביוני בכל שנה, נערכת בהתאם לכללים הנקבעים על ידי העמותה.
4. בכל מועד עדכון מדד, יגרעו מהמדד המניות אשר אינן עומדות בתנאי הסף של המדד וייוספו למדד מניות שעומדות בתנאי הסף של המדד.
5. אין מסלול מהיר להצטרפות מניה למדד.
6. ועדת מדדים תקבע את מגבלת המשקל של מניה במדד ובלבד שלא תעלה על 10%¹.
7. המדד יחושב לפי נוסחת מדד תשואה כוללת ברוטו.
8. מועד השקת המדד - 6 בדצמבר 2020.
9. מדד הבסיס של המדד ביום השקתו יהיה זהה למדד הבסיס של מדד ת"א-125, באותו יום.

¹ ועדת מדדים החליטה כי תקרת משקל של 5% למניה.

מדד ת"א-קנאביס

1. מדד ת"א-קנאביס (להלן: "המדד") הינו מדד בסדרת מדדי תמר.
2. במועד עדכון המדד תיכלל בו כל מניה אשר במועד הקובע לעדכוננו, יתקיימו לגביה התנאים המצטברים הבאים (להלן: "תנאי הסף"):
 - א. נקבע כי תיכלל בתמר.
 - ב. המניה הינה מניה ישראלית.
 - ג. נקבע כי תיכלל ברשימת מניות קנאביס.

לעניין מדד זה -

"רשימת מניות קנאביס" - רשימה הכוללת מניות אשר לפי הסיווג הענפי של הבורסה הן כלולות בתת-ענף "קנאביס" (מספר תת-ענף – 87/05).
3. בכל מועד עדכון מדד, יגרעו מהמדד המניות אשר אינן עומדות בתנאי הסף של המדד וייוספו למדד מניות שעומדות בתנאי הסף של המדד.
4. על אף האמור לעיל, צורפה מניה לתמר במועד שאינו מועד עדכון התמר, תיווסף המניה למדד במועד צירופה לתמר, אם במועד הקובע לעדכון הפרמטרים נכללת המניה ברשימת קנאביס.
5. ועדת מדדים תקבע את מגבלת המשקל של מניה במדד ובלבד שלא תעלה על 20%¹
6. המדד יחושב לפי נוסחת מדד תשואה כוללת ברוטו.
7. מועד השקת המדד - 7 בפברואר, 2021.
8. מדד הבסיס של המדד ביום השקתו יהיה זהה למדד הבסיס של מדד ת"א-ביומד, באותו יום.

¹ לוועדת מדדים החליטה כי תקרת המשקל של מניה במדד תהיה 15%.

מדד ת"א-דואליות

1. מדד ת"א-דואליות (להלן: "המדד") הינו מדד בסדרת מדדי תמר.
2. במועד עדכון המדד תיכלל בו כל מניה אשר במועד הקובע לעדכוננו, יתקיימו לגביה התנאים המצטברים הבאים (להלן: "תנאי הסף"):
 - א. נקבע כי תיכלל בתמר.
 - ב. המניה הונפקה על ידי "חברת חו"ל", כהגדרתה בפרק כ"א בחלק השני לתקנון הבורסה.
 - ג. המניה הינה מניה ישראלית.
3. בכל מועד עדכון מדד, יגרעו מהמדד המניות אשר אינן עומדות בתנאי הסף של המדד וייוספו למדד מניות שעומדות בתנאי הסף של המדד.
4. על אף האמור לעיל, צורפה מניה לתמר במועד שאינו מועד עדכון התמר, תיוסף המניה למדד במועד צירופה לתמר, אם במועד הקובע לעדכון הפרמטרים עמדה בתנאי הסף של המדד.
5. ועדת מדדים תקבע את מגבלת המשקל של מניה במדד ובלבד שלא תעלה על 20%¹
6. המדד יחושב לפי נוסחת מדד תשואה כוללת ברוטו.
7. מועד השקת המדד – 6.6.2021.
8. מדד הבסיס של המדד ביום השקתו יהיה זהה למדד הבסיס של מדד ת"א-גלובל-בלוטק, באותו יום.

¹ ועדת מדדים החליטה כי תקרת המשקל של מניה במדד תהיה 5%.

מדד ת"א-ביטוח

1. מדד ת"א-ביטוח (להלן: "המדד") הינו מדד בסדרת מדדי תמר.
 2. במועד עדכון המדד תיכלל בו כל מניה אשר במועד הקובע לעדכוננו, יתקיימו לגביה התנאים המצטברים הבאים (להלן: "תנאי הסף"):
 - א. נקבע כי תיכלל בתמר.
 - ב. נקבע כי תיכלל ברשימת מניות הביטוח.
 - לעניין מדד זה -
 - ג. "רשימת מניות הביטוח" - רשימה הכוללת מניות אשר לפי הסיווג הענפי של הבורסה כלולות בענף "ביטוח" (מספר ענף - 93/01).
 - המניה הינה מניה ישראלית.
 3. בכל מועד עדכון מדד, יגרעו מהמדד המניות אשר אינן עומדות בתנאי הסף של המדד וייוספו למדד מניות שעומדות בתנאי הסף של המדד.
 4. על אף האמור לעיל, צורפה מניה ישראלית לתמר במועד עדכון פרמטרים שאינו מועד עדכון התמר, תיוסף המניה למדד במועד צירופה לתמר, אם במועד הקובע לעדכון הפרמטרים נכללת המניה ברשימת מניות הביטוח.
 5. ועדת מדדים תקבע את מגבלת המשקל של מניה במדד ובלבד שלא תעלה על 20%¹.
 6. המדד יחושב לפי נוסחת מדד תשואה כוללת ברוטו.
 7. מועד השקת המדד - 1.1.1984.
 8. מדד הבסיס של המדד ביום השקתו – 100.
- מדד ת"א-ביטוח הושק תחילה כמדד "ביטוח מניות והמירים" בתאריך 1 בינואר 1984 לפי בסיס 100. מדד זה היה מתעדכן על בסיס יומי בתום כל יום מסחר. כללי המדד הותאמו למתודולוגיית סדרת מדדי תמר ב-6 ביוני 2021 ושמו עודכן למדד ת"א-ביטוח. מדד זה יתעדכן על בסיס רציף לאורך כל יום המסחר.

¹ ועדת מדדים החליטה כי תקרת המשקל של המדד תהיה 20%.

מדד ת"א-רשתות שיווק

1. מדד ת"א-רשתות שיווק (להלן: "המדד") הינו מדד בסדרת מדדי תמר.
2. במועד עדכון המדד תיכלל בו כל מניה אשר במועד הקובע לעדכוננו, יתקיימו לגביה התנאים המצטברים הבאים (להלן: "תנאי הסף"):
 - א. נקבע כי תיכלל בתמר.
 - ב. נקבע כי תיכלל ברשימת מניות רשתות שיווק.

"רשימת מניות רשתות שיווק" - רשימה הכוללת מניות אשר לפי הסיווג הענפי של הבורסה כלולות בתת ענף "רשתות שיווק" (מספר תת-ענף – 94/07).
 - ג. המניה הינה מניה ישראלית.
3. בכל מועד עדכון מדד, יגרעו מהמדד המניות אשר אינן עומדות בתנאי הסף של המדד וייוספו למדד מניות שעומדות בתנאי הסף של המדד.
4. על אף האמור לעיל, צורפה מניה לתמר במועד שאינו מועד עדכון התמר, תיווסף המניה למדד במועד צירופה לתמר, אם במועד הקובע לעדכון הפרמטרים נכללת המניה ברשימת מניות רשתות שיווק.
5. ועדת מדדים תקבע את מגבלת המשקל של מניה במדד ובלבד שלא תעלה על 20%¹
6. המדד יחושב לפי נוסחת מדד תשואה כוללת ברוטו.
7. מועד השקת המדד – 5.9.2021.
8. מדד הבסיס של המדד ביום השקתו יהיה זהה למדד הבסיס של מדד ת"א-SME150, באותו יום.

¹ וועדת מדדים קבעה כי תקרת המשקל של מניה במדד תהיה 10%.

מדד ת"א-TopNew30

1. מדד ת"א-TopNew30 (להלן: "המדד") הינו מדד בסדרת מדדי תמר.
2. במועד עדכון המדד תיכלל בו כל מניה אשר במועד הקובע לעדכנו, יתקיימו לגביה התנאים המצטברים הבאים (להלן: "תנאי הסף"):
 - א. נקבע כי תיכלל ברימון.
 - ב. במועד העדכון, טרם חלפו 5 שנים מהיום בו נכללה המניה במדד לראשונה.
 - ג. במועד העדכון טרם חלפו 5 שנים מאז נרשמה למסחר לראשונה. ד. למרות האמור בס"ק ג., אם נכללה מניה במדד, ובמועד העדכון טרם חלפו 5 שנים מהיום בו נכללה המניה במדד, היא לא תוצא מהמדד גם אם חלפו למעלה מחמש שנים מאז נרשמה למסחר, והתנאי שטרם חלפו 10 שנים מהמועד בו נרשמה למסחר.
3. במדד יכללו 30 מניות אשר במועד הקובע לעדכון המדד יהיו בעלות שווי השוק הממוצע הגבוה ביותר מבין המניות העומדות בתנאי הסף של המדד, בכפוף לאמור בסעיפים 4-6 להלן.
4. בכל מועד עדכון מדד, תעודכן רשימת המניות הכלולות במדד לפי השלבים המפורטים להלן:
 - א. במועד הקובע לעדכון המדד ידורגו המניות שעומדות בתנאי הסף של המדד על פי דירוג שווי שוק ממוצע.
 - ב. במועד עדכון המדד יגרעו מהמדד הן המניות אשר אינן עומדות בתנאי הסף של המדד והן המניות אשר דורגו על פי דירוג שווי שוק ממוצע בדירוג שווה ל-40 (מה זה?) או נמוך ממנו וייוספו למדד מניות שדורגו על פי דירוג שווי שוק ממוצע בדירוג שווה ל-20 או גבוה ממנו.
 - ג. אם לאחר גריעת מניות מהמדד והוספת מניות למדד, כמפורט בסעיף 4.ב. לעיל, נכללות ברשימה יותר מ-30 מניות, יגרעו מהרשימה מניות נוספות, אשר דורגו על פי דירוג שווי שוק ממוצע בדירוג הנמוך ביותר מבין המניות שנכללו ברשימה, על פי סעיף 4.ב. לעיל, עד שברשימה יכללו 30 מניות.
 - ד. אם לאחר גריעת מניות מהמדד והוספת מניות למדד, כמפורט בסעיף 4.ב. לעיל, נכללות ברשימה פחות מ-30 מניות, תיוספנה לרשימה מניות אשר דורגו על פי דירוג שווי שוק ממוצע בדירוג הגבוה ביותר מבין המניות שלא נכללו ברשימה, על פי סעיף 4.ב. לעיל, עד שברשימה יכללו 30 מניות.
 - ה. על אף האמור לעיל, אם נותרו פחות מ-20 מניות במדד, לא יגרעו מהמדד המניות בעלות הותק הנמוך ביותר, לרבות מניות שלא עומדות בתנאי הסף של המדד, עד שיוותרו במדד 20 מניות.
5. אין מסלול מהיר למדד.
6. ועדת מדדים תקבע את מגבלת המשקל של מניה במדד ובלבד שלא תעלה על 20%¹.
7. המדד יחושב לפי נוסחת מדד תשואה כוללת ברוטו.
8. מועד השקת המדד – יקבע בסיום ההיערכות הטכנית.
9. מדד הבסיס של המדד ביום השקתו יהיה זהה למדד הבסיס של מדד ת"א-רימון באותו יום.

¹ ועדת מדדים החליטה כי תקרת המשקל של מניה במדד תהיה 5%.

מדד ת"א-בנקים

1. מדד ת"א-בנקים (להלן: "המדד") הינו מדד בסדרת מדדי תמר.
 2. במועד עדכון המדד תיכלל בו כל מניה אשר במועד הקובע לעדכונו, יתקיימו לגביה התנאים המצטברים הבאים (להלן: "תנאי הסף"):
 - א. מניות אשר נכללת במאגר תמר.
 - ב. מניות אשר במועד הקובע לעדכון התמר נכללות בענף "בנקים מסחריים" לפי סיווג הבורסה.
 - ג. השווי הממוצע של החזקות הציבור במניה:
 - 1) אם המניה נכללת במדד - השווי הממוצע של החזקות הציבור במניה לא יפחת מ-4 מיליארד ש"ח.
 - 2) אם המניה אינה נכללת במדד - השווי הממוצע של החזקות הציבור במניה לא יפחת מ-5 מיליארד ש"ח.
 - ג. המניה הינה מניה ישראלית.
 3. בכל מועד עדכון מדד, יגרעו מהמדד המניות אשר אינן עומדות בתנאי הסף של המדד וייוספו למדד מניות שעומדות בתנאי הסף של המדד.
 4. תקרת המשקל במדד תיקבע כמפורט להלן:
 - א. שתי המניות בעלות שווי השוק הממוצע הגבוה ביותר במועד הקובע – 22%
 - ב. שלוש המניות הגדולות הבאות אחריהן – 20%
 - ד. שאר המניות – 2%
- עלה משקלה של מניה ל-24% ויותר – יחושב פקטור מגבלת המשקל מחדש בתום המסחר למחרת היום בו משקל המניה היה לפחות 24% כאמור.
5. המדד יחושב לפי נוסחת מדד תשואה כוללת ברוטו.
 6. מועד השקת המדד - 16 באפריל 2023.
 7. מדד הבסיס של המדד ביום השקתו יהיה זה למדד הבסיס של ת"א-בנקים 5.

מדד ת"א-125 EW

1. מדד ת"א-125 EW (להלן: "המדד") הינו מדד בסדרת מדדי תמר.
2. במדד יכללו כל המניות אשר נכללות במדד ת"א-125 בלבד.
3. בכל מועד עדכון מדד, יגרעו מהמדד המניות אשר נגרעו מת"א-125 וייוספו למדד מניות שייוספו לת"א-125.
4. צורפה מניה למדד ת"א-125, תיווסף המניה גם למדד ת"א-125 EW. נגרעה מניה ממדד ת"א-125, תיגרע המניה גם ממדד ת"א-125 EW.
5. תקרת המשקל במדד – משקל אחיד
6. המדד יחושב לפי נוסחת מדד תשואה כוללת ברוטו.
7. מועד השקת המדד - 16 באפריל 2023.
8. מדד הבסיס של המדד ביום השקתו יהיה זהה למדד הבסיס של מדד ת"א-125, באותו יום.

מדד ת"א-125 ערך

1. מדד ת"א-125 ערך (להלן: "המדד") הינו מדד בסדרת מדדי תמר.
2. המדד יעודכן אחת לשנה, במועד עדכון התמר בחודש נובמבר, בכל שנה (להלן: "מועד עדכון המדד").
המועד הקובע לעדכון המדד יהיה המועד הקובע לעדכון נובמבר של מאגר תמר, (להלן: "המועד הקובע לעדכון המדד").
3. בכפוף לאמור להלן, במדד יכללו 60 המניות הנכללות במדד ת"א - 125 שהחברות שהנפיקו אותן הינן בעלות ציון הערך הסופי (Value Score) הגבוה ביותר.
"ציון הערך הסופי (Value Score)" – כפי שנקבע בהתאם למנגנון החישוב המצורף בנספח 1 להלן.
4. במועד עדכון המדד תיכלל בו כל מניה אשר במועד הקובע לעדכונה, יתקיימו לגביה התנאים המצטברים הבאים (להלן: "תנאי הסף"):
א. נקבע כי תיכלל במדד ת"א-125.
ב. המניה כאמור, הונפקה על ידי חברה הנכללת ברשימת חברות הערך לעניין זה "רשימת חברות הערך" - רשימה המורכבת מ- 60 החברות אשר ציון הערך הסופי (Value Score) שלהן הוא הגבוה ביותר מבין החברות אשר נקבע כי מניותיהן יכללו במדד ת"א - 125, כאמור בס"ק א..
ברשימה כאמור, יכללו לכל היותר 10 מניות מכל תת-ענף, כאשר לעניין זה תת-ענף "נדל"ן מניב בחו"ל" (מספר תת-ענף - 95/06) ותת-ענף "נדל"ן מניב בישראל" (מספר תת-ענף - 95/05), יחשבו כתת-ענף אחד.
5. בכל מועד עדכון מדד, תעודכן רשימת חברות הערך לפי השלבים המפורטים להלן:
א. במועד הקובע לעדכון המדד ייקבע לכל חברה אשר נקבע כי המניה שהנפיקה תיכלל במדד ת"א-125, כאמור לעיל, ציון ערך סופי (Value Score). לאחר שנקבע הציון כאמור, ידורגו החברות בהתאם לציון הערך הסופי (Value Score), מהנמוך לגבוה (להלן: "הדירוג").
ב. חברות אשר דירוגן שווה ל-75 או נמוך ממנו ייגרעו מהרשימה ואילו חברות אשר דירוגן שווה ל-45 או גבוה ממנו ייוספו לרשימה.
ג. אם לאחר ביצוע האמור בסעיף 5.ב. לעיל, נכללות ברשימה יותר מ-60 חברות, יגרעו מהרשימה חברות נוספות, אשר דירוגן הוא הנמוך ביותר מבין החברות שנכללו ברשימה על פי סעיף 5.ב. לעיל, עד שהרשימה תכלול 60 חברות בלבד.
ד. אם לאחר ביצוע האמור בסעיף 5.ב. לעיל, נכללות ברשימה פחות מ-60 חברות, תיוספנה לרשימה חברות אשר דירוגן הוא הגבוה ביותר מבין החברות שלא נכללו ברשימה על פי סעיף 5.ב. לעיל, עד שברשימה יכללו 60 חברות.
6. אין מסלול מהיר לצירוף מניה מדד.
7. תקרת המשקל במדד – 5%.
8. המדד יחושב לפי נוסחת מדד תשואה כוללת ברוטו.
9. מועד השקת המדד – 5 במאי 2024. המועד הקובע לצורך קביעת 60 המניות הראשונות שיכללו במדד הינו 11 באפריל 2024.

מדריך מעו"ף-עדכון מס' 142 מעודכן עד ליום 10.4.24 - 274768

10. מדד הבסיס של המדד ביום השקתו יהיה זהה למדד הבסיס של מדד ת"א-125 באותו יום.

נספח 1 – מדד ת"א-125 ערך - מנגנון לקביעת ציון הערך הסופי (Value Score) של המניות

בדיקת ציון הערך הסופי תעשה אחת לשנה לקראת מועד עדכון נובמבר של מאגר תמר (להלן: "מועד העדכון") על סמך הנתונים הנכללים בדוחות הכספיים השנתיים המאוחדים (להלן: "הדוחות הכספיים השנתיים") כפי שמתואר להלן:

1. הגדרת יחסים פיננסיים

א. P/E (מכפיל רווח):

$\left(\frac{P}{E}\right)_i^j$ - היחס בין שווי השוק של המניה i ביום המסחר האחרון של שנה קלנדרית j לבין הרווח הנקי

המיוחס לבעלי המניות, כפי שהוא מופיע בדוחות הכספיים השנתיים של שנה זו.

מכפיל הרווח יחושב עבור כל אחת משלוש השנים הקלנדריות שהסתיימו לפני מועד העדכון.

ב. P/B (מכפיל החון):

$\left(\frac{P}{B}\right)_i^j$ - היחס בין שווי השוק של המניה i ביום המסחר האחרון של שנה קלנדרית j , לבין החון העצמי

כפי שהוא מופיע בדוחות הכספיים השנתיים של שנה זו, בניכוי זכויות מיעוט.

מכפיל החון יחושב עבור כל אחת משלוש השנים הקלנדריות שהסתיימו לפני מועד העדכון.

ג. Div (תשואת הדיבידנד):

"תשואת הדיבידנד השנתית" לענין מדד זה, תחושב כמפורט בנוסחה להלן:

$$Div = \sum_{i=1}^n \frac{d_z}{P_z}$$

כאשר -

Div - תשואת הדיבידנד השנתית של המניה

d_z - דיבידנד ברוטו z באגורות, אשר שולם לבעלי המניות באמצעות מסלקת הבורסה

P_z - שער הנעילה של המניה ביום הקובע לתשלום הדיבידנד z

n - מספר הפעמים ששולם דיבידנד לבעלי המניות בין 1.1 ל- 31.12 בשנה הרלוונטית.

תשואת הדיבידנד השנתית תחושב עבור כל אחת משלוש השנים הקלנדריות שהסתיימו לפני מועד העדכון, בהתאם לדיבידנד שחולק באותה שנה.

ד. היחסים הפיננסיים המוגדרים בסעיפים קטנים א.-ג. לעיל יחושבו באופן הבא:

1) עבור מניות המסווגות, לפי הסיווג הענפי של הבורסה, בענף "בנקים", בתת-ענף "נדל"ן מניב ישראל" או בתת-ענף "נדל"ן מניב חו"ל" יחושבו מכפיל הון (P/B) ותשואת הדיבידנד (Div) בלבד.

2) במקרים הבאים ערך המכפיל ייקבע כערך השווה לאחוזון ה-95 של טווח הערכים שאינם שליליים לשנה הרלוונטית:

- המכפיל אינו זמין;

- המכפיל שלילי;

- המכפיל נמצא מעל האחוזון ה-95 של טווח הערכים שאינם שליליים.

3) במקרים בהם המכפיל נמוך מהאחוזון ה-5 של טווח הערכים הקיימים שאינם שליליים לשנה הרלוונטית, ערך המכפיל ייקבע כערך השווה לאחוזון ה-5 של הטווח הנ"ל.

2. חישוב יחסים פיננסיים משוקללים

א. עבור כל אחד מהטווחים של יחס פיננסי (k) לכל אחת משלוש השנים הקלנדריות שקדמו למועד הקובע, כפי שמוגדר בסעיף 1. לעיל יחושבו ממוצע וסטיית תקן כלהלן:

$$\mu_k^j = \frac{\sum_{i=1}^n M_{i,k}^j}{n}$$

$$\sigma_k^j = \sqrt{\frac{\sum_{i=1}^n (M_{i,k}^j - \mu_k^j)^2}{n - 1}}$$

k - יחס פיננסי P/E או יחס פיננסי P/B או יחס פיננסי Div, לפי העניין

μ_k^j - ממוצע של טווח של מכפילים משוקללים לשנה j

σ_k^j - סטיית תקן של טווח של מכפילים משוקללים לשנה j

$M_{i,k}^j$ - יחס פיננסי k עבור מניה i לשנה j

n - מספר המניות שעתידות להיכלל במדד ת"א-125 במועד עדכון המדדים הקרוב

ב. חישוב יחסים פיננסיים מנורמלים סטטיסטיים

כל יחס פיננסי $M_{i,k}^j$ ינורמל ביחס לממוצע וסטיית התקן של הטווח הרלוונטי כלהלן:

$$St. M_i^j = \frac{M_{i,k}^j - \mu_k^j}{\sigma_k^j}$$

ג. יחס פיננסי משוקלל

עבור כל מניה i יחושב יחס פיננסי משוקלל כלהלן:

$$WM_i^k = 0.4 * St. M_i^Y + 0.3 * St. M_i^{Y-1} + 0.3 * St. M_i^{Y-2}$$

כאשר:

k - יחס פיננסי P/E או יחס פיננסי P/B או יחס פיננסי Div, לפי העניין

j - שנה Y או Y-1 או Y-2, לפי העניין.

3. חישוב Z-Score ("ציון ערך ראשוני")

Z-Score ("ציון ערך ראשוני") של חברה i מחושב כממוצע פשוט של היחסים הפיננסיים המשוקללים P/B, P/E ויחס פיננסי Div מוכפל ב-(-1) הרלוונטיים לחברה כפי שמוגדר בסעיף 2.ג. לעיל:

$$Z - Score_i = \frac{WM_i^{\frac{P}{E}} + WM_i^{\frac{P}{B}} + (-1) * WM_i^{Div}}{3}$$

4. חישוב Value-Score ("ציון ערך סופי")

א. חישוב ערכי $ValueScore_i$ ("ציוני ערך סופיים") לכל אחת מהחברות מתבצע באמצעות נירמול ערכי Z-Score כמפורט להלן:

$$ValueScore_i = \begin{cases} Z - Score_i + 1, & Z - Score_i > 0 \\ \frac{1}{1 - Z - Score_i}, & Z - Score_i < 0 \\ 0, & Z - Score_i = 0 \end{cases}$$