



# מתודולוגית מדדים - מדדי מניות

מרץ 2024

---

## תוכן עניינים

### עמוד

5

רקע

6

הגדרות

10

תנאי סף כלליים במדדים

11

מאפייני המדדים

11

אינדקס בנקים ישראל

13

אינדקס בנקים משקל שווה

15

אינדקס ביטוח-5 ישראל

17

אינדקס ביטוח משקל שווה

19

אינדקס בנקים וביטוח ישראל

21

אינדקס אשראי חוץ בנקאי ושירותים פיננסיים אחרים בישראל

23

אינדקס פיננסים ישראל איזון ענפי

25

אינדקס נדל"ן ישראלי

27

אינדקס נדל"ן למגורים בישראל

29

אינדקס נדל"ן משרדים ומרכזי קניות בישראל

31

אינדקס בנייה ישראל - פקטור מינוף פיננסי נמוך

33

אינדקס צריכה ישראלית

35

אינדקס צריכה בסיסית ישראל

37

אינדקס צריכה מחזורית ישראל

39

אינדקס קמעונאות ומסחר ישראל

41

אינדקס מזון ישראלי

43

אינדקס טכנולוגיה ישראל EW

45

אינדקס תעשייה ישראל

47

אינדקס תשתיות לאומיות ישראל

49

אינדקס בינוי והנדסת תשתיות

51

אינדקס אנרגיה ישראלית

53

אינדקס אנרגיה מתחדשת ישראל

55

אינדקס 120 ישראל

57

אינדקס 40 ישראל

59

אינדקס 80 ישראל מיד קאפ

61

אינדקס ישראל 100 משקל שווה

63

אינדקס ת"א MID CAP

65

אינדקס ת"א SMALL-MID CAP

67

אינדקס מניות ערך ישראל

69

אינדקס מניות ערך ישראל איזון סקטוריאלי

71

אינדקס מניות דיבידנד ישראל

73

אינדקס מניות צמיחה ישראל

75

אינדקס ת"א-QUALITY 125

77

אינדקס ת"א-SMART MOMENTUM 125

79

אינדקס ת"א-125 מומנטום ענפי

81

אינדקס מניות במומנטום שלילי

83

אינדקס ESG 100 אנטרופי

86

אינדקס ישראל הנהגה נשית

88

אינדקס חברות ישראליות טופ-150

90

אינדקס חברות ישראליות טופ-50

92

אינדקס מנגנון מניות ישראל-ארה"ב

95

אינדקס ישראליות בוול-סטריט

97

אינדקס הייטק ישראלי בחו"ל

99

אינדקס ישראליות צמיחה-מומנטום

101	אינדקס שבבים וציוד טכנולוגי ישראלי	•
103	אינדקס תוכנה ישראלית	•
105	אינדקס תעשיות ביטחוניות ארה"ב וישראל	•
107	GLOBAL 100 INDEX	•
109	GLOBAL 50 EX US INDEX	•
111	אינדקס ערך עולמי	•
113	אינדקס צמיחה עולמי	•
115	אינדקס מומנטום ארה"ב	•
117	אינדקס מניות ארה"ב LARGE CAP מומנטום ענפי	•
119	אינדקס ארה"ב מודל תמחור מומנטום	•
121	אינדקס מניות ערך ארה"ב	•
123	אינדקס מניות ערך ארה"ב פיזור סקטוריאלי	•
125	TOP10 TECH אינדקס	•
127	אינדקס ביג טק 30 ארה"ב	•
129	אינדקס ביג טק 30 סין	•
131	אינדקס מוליכים למחצה גלובלי EW	•
133	GLOBAL SEMICONDUCTORS אינדקס	•
135	אינדקס שבבים גלובלי - מבוסס AI	•
137	ASIA SEMICONDUCTORS אינדקס	•
139	אינדקס שבבים ארה"ב TOP10	•
141	אינדקס יצרני ציוד לשבבים גלובלי	•
143	אינדקס סייבר גלובלי משקל שווה	•
145	אינדקס סייבר ארה"ב - מבוסס AI	•
148	אינדקס סייבר ארה"ב TOP10	•
150	אינדקס סייבר למיחשוב ענן גלובלי	•
152	WORK FROM HOME אינדקס	•
154	CLOUD COMPUTING אינדקס	•
156	EGAMING אינדקס	•
158	אינדקס תשלומים דיגיטליים גלובלי	•
160	MEGA 20 US BANKS אינדקס	•
162	אינדקס מפעלי בורסות עולמיות	•
164	אינדקס REIT נדל"ן למגורים ארה"ב TOP10	•
166	SHOPPING CENTERS REIT אינדקס	•
168	אינדקס חברות צריכה סיניות	•
170	אינדקס יצרני מזון TOP10 גלובל	•
172	FOOD BRANDS TOP 10 אינדקס	•
174	PETS CARE אינדקס	•
176	אינדקס בריאות דיגיטלית גלובלי	•
178	אינדקס פודטק גלובלי	•
180	אינדקס פודטק גלובלי - מבוסס AI	•
183	אינדקס רכב חשמלי גלובלי	•
185	TRAVEL אינדקס	•
187	אינדקס תיירות גלובלי - מבוסס AI	•
190	אינדקס אנרגיה ירוקה גלובלי - מבוסס AI	•
193	אינדקס אגירת אנרגיה גלובלי	•
195	אינדקס תשתיות חיוניות גלובלי - מבוסס AI	•
198	אינדקס תשתיות ובינוי ארה"ב	•
200	אינדקס שילוח אווירי ויבשתי גלובלי	•
202	GLOBAL MANUFACTURERS אינדקס	•
204	MARINE SHIPPING אינדקס	•
206	GLOBAL METALS & MINERALS PRODUCERS אינדקס	•
<b>208</b>		

## מועדי עדכון

208	מועדי עדכון מניות ישראל
208	מועדי עדכון מניות גלובל
<b>209</b>	<b>משקל נייר ערך במדדים</b>
209	תקרות משקל במדדי שווי שוק
209	חישוב משקל נייר ערך במדדים
209	קביעת כמות היחידות של נייר ערך במדד
210	חישוב ועדכון פקטור מגבלת משקל של נייר ערך במדד
<b>211</b>	<b>שערי המדדים</b>
211	חישוב שערי המדדים
211	אופן חישוב שערי המדדים
211	תדירות חישוב שערי המדדים
211	פרסום שערי המדדים
<b>212</b>	<b>כללי</b>
212	הבהרות
212	הפצת נתוני מדדים
<b>213</b>	<b>דיסקליימר</b>

---

מדדי אינדקס המוצגים במסמך זה פותחו במטרה למדוד את ביצועיהם של אפיקי השקעה שונים בשוקי המניות בישראל ובעולם, וכן, נועדו לשמש כמשפחת מדדי השקעה בתחום המניות.

המדדים פותחו לצורך שימוש של יועצי השקעות, מנהלי השקעות פרטיים ומוסדיים, קרנות השקעה לכל סוגיהן, חדרי עסקאות וגופי מסחר בניירות ערך.

המתודולוגיה המפורטת במסמך זה נבנתה על ידי אינדקס כדי להשיג את המטרה האמורה של מדידת ביצועי נכסי הבסיס של כל מדד המפורסם במסמך זה. כל שינוי או חריגה מהמתודולוגיה המפורטת מטה תיעשה על פי שיקול דעתו הבלעדי של עורך המדד באופן שמטרתו להבטיח כי המדדים ימשיכו להשיג את מטרתם.

להלן ביאור של מונחים עיקריים לעניין מסמך זה:

**"אינדקס"** או **"עורך המדד"** - אינדקס מחקר ופיתוח מדדים בע"מ.

**"ועדת מדדים"** - הרכב המונה לכל הפחות 3 בעלי מומחיות בתחום המדדים ותפקידו לקבל החלטות בהתאם למתודולוגיית המדד ו/או במקרים מיוחדים בהתאם לנהלים וכללים ברורים שנקבעו מראש.

**"רשות ני"ע"** - רשות ניירות ערך בישראל.

**"בנק ישראל"** - הבנק המרכזי של מדינת ישראל.

**"למ"ס"** - הלשכה המרכזית לסטטיסטיקה בישראל.

**"בורסה"** - זירת מסחר של ניירות ערך.

**"מסחר מחוץ לדלפק (OTC)"** - מסחר בניירות ערך ובמכשירים פיננסיים אשר אינו מבוצע בבורסה אלא באופן ישיר בין הצד הקונה לבין הצד המוכר.

**"הבורסה בת"א"** - המונח מתייחס לבורסה לניירות ערך בתל-אביב.

**"מדינת תושבות"** - המדינה הריבונית הנחשבת למקום בו מנוהלת ונשלטת החברה.

**"מדינת מטה חברה"** - המדינה הריבונית בה שוכנים המשרדים הראשיים של החברה.

**"סנקציות השקעה"** - איסור על ביצוע השקעות ו/או התקשרות עם מדינות ריבוניות ו/או תאגידים הקשורים לאותן מדינות ריבוניות בשל היותן מדינות מפרות חוקים בינלאומיים.

**"האיחוד האירופי"** - התאגדות של מרבית מדינות באירופה לכדי איחוד כלכלי ופוליטי בעל מאפיינים של מדינת-על.

**"מערכת מידע פיננסי"** - מערכת הפצה של מידע על ניירות ערך מבורסות ומספקי מידע פיננסי אחרים. מערכות מידע פיננסי נפוצות בעולם הן של גופים כדוגמת בלומברג, Refinitiv (לשעבר תומפסון רויטרס), ICE, S&P, FactSet ומורנינגסטאר.

**"סיווג GICS"** - סיווג מגזרי פעילות שפותח ומנוהל על ידי S&P ו- MSCI במטרה לייצר סטנדרט בינלאומי אחיד (Global Industry Classification Standard). הסיווג כולל ארבע שכבות, כאשר השכבה העליונה מורכבת מ-11 סקטורים מרכזיים: אנרגיה, בריאות, חומרי גלם, טכנולוגיה, צריכה בסיסית, צריכה מחזורית, נדל"ן, פיננסים, תעשייה, תקשורת ותשתיות.

**"סיווג iINDEX-Tree"** - סיווג מגזרי פעילות שפותח ומנוהל על ידי אינדקס במטרה לייצר סטנדרט אחיד לכל המדדים שבהם קיימים תנאי סף ענפיים. מתודולוגיית הסיווג מפורטת במסמך "iINDEX-Tree Classifications".

**"סיווג iINDEX-Geo"** - סיווג גיאוגרפי שפותח ומנוהל על ידי אינדקס במטרה לייצר סטנדרט אחיד לכל המדדים שבהם קיימים תנאי סף גיאוגרפיים. מתודולוגיית הסיווג מפורטת במסמך "iINDEX-Geo Classifications".

**"נייר ערך"** - תעודה המונפקת על ידי מדינה ריבונית או יישות אחרת בשליטתה או על ידי חברה, שותפות או כל תאגיד אחר ומקנה למחזיק בה זכויות בהתאם למפורט במסמכי התעודה.

**"נכס פיננסי"** - נכס, שאינו נייר ערך, המקנה למחזיק בו זכויות בהתאם לסוג הנכס הפיננסי. נכס פיננסי מסוג פיקדון מקנה למחזיק ריבית הנצברת לפי אורך תקופת החזקה בנכס הפיננסי.

**"מנפיק"** - הישות המשפטית שהנפיקה נייר ערך.

**"מניה רגילה"** - נייר ערך המעניק למחזיק בו זכויות הצבעה באספה הכללית של בעלי המניות הרגילות וזכות להשתתפות בחלוקת רווחי החברה או בחלוקת נכסי החברה במקרה של פירוק.

**"מניית בכורה"** - נייר ערך המעניק למחזיק בו זכות עדיפה להשתתפות בחלוקת רווחי החברה אולם אינו מקנה זכויות הצבעה באספה הכללית של בעלי המניות הרגילות.

**"יחידת השתתפות בשותפות מוגבלת"** - נייר ערך המעניק למחזיק בו זכות להשתתפות בחלוקת רווחי השותפות המוגבלת שהנפיקה את נייר הערך, אולם הוא אינו מקנה זכות בקבלת החלטות שוטפות של השותפות המוגבלת.

**"תעודת מניה אמריקאית (ADR)"** - נייר ערך שנרשם למסחר באחת הבורסות בארה"ב בידי מוסד פיננסי מורשה ומייצג מניה של חברה שמקום התאגדותה מחוץ לארה"ב. חלק מתעודות המניה האמריקאיות (ADR) הן תחת חסות אותה חברה (Sponsored Depositary Receipt) וחלק מהתעודות הן ללא חסות החברה.

**"קרן נאמנות"** - מכשיר פיננסי שמטרתו השקעה משותפת בניירות ערך והפקת רווחים משותפת מהחזקתם ומכל עסקה בהם.

**"קרן ריט (REIT)"** - קרן נאמנות ייעודית להשקעה במקרקעין.

**"יחידת השתתפות בקרן ריט (REIT)"** - נייר ערך המעניק למחזיק בו זכות להשתתפות בחלוקת רווחי קרן הריט שהנפיקה את נייר הערך, אולם הוא אינו מקנה זכות בקבלת החלטות שוטפות של קרן הריט.

**"קרן סל (ETF)"** - קרן נאמנות הנסחרת בבורסה ועוקבת אחר מדד המורכב מניירות ערך או מנכסים פיננסיים אחרים.

**"מועד עדכון"** - המועד שבו נכנס לתוקף עדכון הרכב מדד ו/או עדכון משקלות על פי מתודולוגיית המדד.

**"מועד קובע לעדכון מדד"** - המועד שבו מקבעים את המידע והנתונים הנדרשים לצורך עדכון מדד.

**"תנאי סף"** - דרישה הכרחית שנייר ערך מחויב לעמוד בה על מנת להיות מועמד להיכללות במדד במועד הקובע.

**"מחיקה ממסחר"** - מחיקת רישום של נייר ערך מהמסחר בבורסה.

**"השעיית מסחר"** - הפסקת מסחר בנייר ערך לפרק זמן העולה על פרק הזמן המקובל להפסקה זמנית של מסחר בנייר ערך מסוים.

**"מסלול מהיר להוספת ניירות ערך"** - אפשרות להוספת נייר ערך למדד בעדכון מדד שאינו עדכון הרכב מדד (עדכון משקלות למשל), בכפוף לעמידת נייר הערך בתנאי הסף שנקבעו במסגרת המסלול המהיר.

**"התחלת שערים היסטוריים"** - מועד תחילת הנתונים ההיסטוריים של המדד, בו ניתן לו ערך בסיס מסוים.

**"ערך בסיס"** - שער המדד במועד התחלת השערים ההיסטוריים.

**"תחילת פרסום"** - המועד בו פורסמו לראשונה באופן פומבי נתוני המדד.

**"שווי נכסים נקי"** - הערך הנקי של נכסי קרן נאמנות בניכוי התחייבויותיה, חלקי מספר יחידות הקרן שהונפקו.

**"שווי שוק"** - ההון הרשום למסחר של מניה, מוכפל בשער הנעילה שנקבע לאותה מניה, ביום מסוים.

**"שווי שוק ממוצע"** - שווי השוק של נייר ערך במועד הקובע לעדכון המדדים.

**"שיעור החזקות ציבור"** - המשקל שמהוות החזקות הציבור, מכלל ניירות הערך של החברה מאותו סוג.

**"שווי שוק החזקות ציבור"** - שווי שוק ממוצע מוכפל בשיעור החזקות הציבור.

**"דירוג שווי שוק ממוצע"** - דירוג, לפי שווי שוק ממוצע, של ניירות הערך העומדים בתנאי הסף של המדד. נייר הערך בעל שווי השוק הממוצע הגבוה ביותר ידורג בדירוג "1" ויחשב לנייר הערך המדורג הגבוה ביותר. נייר הערך בעל שווי

השוק הממוצע השני הגבוה ביותר ידורג בדירוג "2" ויחשב לנייר הערך המדורג בדירוג השני הגבוה ביותר, וכן הלאה. ניירות ערך בעלי שווי שוק ממוצע זהה ידורגו בדירוג זהה.

**"מדד תשואה כוללת ברוטו (GTR)"** - מדד השקעה ברוטו ממס משקף את השינויים בשערי ניירות הערך הכלולים במדד בתוספת השקעה מחדש במדד של כל התקבולים (כדוגמת דיבידנדים ו/או ריביות) והזכויות שהתקבלו בגין ההחזקה בניירות הערך הכלולים במדד, ללא ניכוי המס בגין התקבולים והזכויות כאמור.

**"מדד תשואה כוללת נטו (NTR)"** - מדד השקעה נטו ממס משקף את השינויים בשערי ניירות הערך הכלולים במדד בתוספת השקעה מחדש במדד של כל התקבולים (כדוגמת דיבידנדים ו/או ריביות) והזכויות שהתקבלו בגין ההחזקה בניירות הערך הכלולים במדד, לאחר ניכוי המס הנדרש בגין התקבולים והזכויות כאמור.

**"מדד מחיר"** - מדד מחיר משקף רק את השינויים בשערי ניירות הערך הכלולים במדד.

**"מנגנון קביעת משקולות"** - הפרמטר העיקרי שבו נעשה שימוש במסגרת הנוסחאות לחישובי משקל של ניירות הערך במדד.

**"תקרת משקל"** - המשקל המירבי באחוזים של נייר ערך, מנפיק, תחום פעילות ענפי או קבוצת ניירות ערך מסוימת בעלת מאפיינים דומים במדד.

**"משקל מינימלי"** - המשקל המזערי באחוזים של נייר ערך, מנפיק, תחום פעילות ענפי או קבוצת ניירות ערך מסוימת בעלת מאפיינים דומים במדד.

**"פקטור מגבלת משקל"** - פרמטר שנועד להתאמת משקלן של מניות אשר במועד עדכון המשקולות במדד שיעורן עמד על תקרת המשקל של מניה במדד.

**"מדד שווי שוק"** - מדד שבו מנגנון קביעת המשקולות מתבסס על שווי השוק של ניירות הערך הנכללים במדד, באופן שהמשקל מחושב כיחס שבין שווי שוק של נייר ערך מסוים במדד לבין שווי השוק המצרפי של כל ניירות הערך הנכללים במדד, בכפוף למגבלות המשקל במדד ולמגבלות נוספות שנקבעו בו.

**"מדד משקל אחיד"** - מדד שבו מנגנון קביעת המשקולות מתבסס על כמות ניירות הערך הנכללים במדד, באופן שהמשקל מחושב כך שניתן משקל זהה לכל ניירות הערך הנכללים במדד, בכפוף למגבלות משקל מסוימות שנקבעו במדד.

**"מדד משקל דירוג ESG"** - מדד שבו מנגנון קביעת המשקולות מתבסס על דירוג ESG של מנפיקי ניירות הערך הנכללים במדד, באופן שהמשקל מחושב כיחס שבין דירוג ESG של נייר ערך מסוים במדד לבין דירוג ESG המשוקלל של כל ניירות הערך הנכללים במדד, בכפוף למגבלות המשקל במדד ולמגבלות נוספות שנקבעו בו.

**"מדד משקל מומנטום"** - מדד שבו מנגנון קביעת המשקולות מתבסס על ציון מומנטום של ניירות הערך הנכללים במדד, באופן שהמשקל מחושב כיחס שבין ציון מומנטום של נייר ערך מסוים במדד לבין ציון המומנטום המשוקלל של כל ניירות הערך הנכללים במדד, בכפוף למגבלות המשקל במדד ולמגבלות נוספות שנקבעו בו.

**"נכס מאזני"** - חומר או מוצר כדוגמת מלאי ורכוש קבוע המצוי בשליטת החברה ומשמש אותה לטובת פעילותה העסקית. **"רווח נקי שנתי"** - הרווח הנקי המצטבר של חברה בשנה קלנדרית מלאה.

**"הכנסה שנתית"** - סך ההכנסות המצטברות של חברה בשנה קלנדרית מלאה כפי שמפורט בדוחות הכספיים של החברה.

**"תזרים מזומנים"** - תזרים המזומנים מפעילות שוטפת של חברה, על פי המידע המפורסם בדוחות הכספיים של השנתיים של המנפיק.



**"דיבידנד"** - תשלום שמעבירה חברה לידי בעלי מניותיה.

**"מכפיל הון (P/B)"** - יחס המתקבל כתוצאה מחלוקת שווי שוק של נייר ערך בהון העצמי למאזן של אותה חברה, על פי המידע המפורסם בדוחות הכספיים של החברה.

**"מכפיל מכירות (P/S)"** - יחס המתקבל כתוצאה מחלוקת שווי שוק של נייר ערך בסך ההכנסות המצטברות של החברה בארבעת הרבעונים המדווחים האחרונים שלה, על פי המידע המפורסם בדוחות הכספיים של החברה.

**"מכפיל רווח (P/E)"** - יחס המתקבל כתוצאה מחלוקת שווי שוק של נייר ערך ברווח (הפסד) המצטבר של החברה בארבעת הרבעונים המדווחים האחרונים שלה, על פי המידע המפורסם בדוחות הכספיים של החברה.

**"מכפיל תזרים מזומנים"** - יחס המתקבל כתוצאה מחלוקת שווי שוק של נייר ערך בתזרים המזומנים של החברה בארבעת הרבעונים המדווחים האחרונים שלה, על פי המידע המפורסם בדוחות הכספיים של החברה.

**"יחס שווי פעילות לרווח לפני הוצאות ריבית מס פחת והפחתות (EV/EBITDA)"** - יחס המתקבל כתוצאה מחלוקת שווי שוק של חברה בתוספת החוב שלה ובניכוי מזומנים ושווי מזומנים (מונה) ברווח הנקי השנתי של החברה בתוספת הוצאות מסים, ריבית, פחת והפחתות (מכנה).

**"תשואה על ההון העצמי"** - יחס המתקבל כתוצאה מחלוקת הרווח הנקי השנתי של החברה בהון העצמי למאזן של אותה חברה, על פי המידע המפורסם בדוחות הכספיים השנתיים של החברה.

**"הון עצמי מוחשי למאזן"** - יחס המתקבל כתוצאה מחלוקת ההון העצמי בניכוי נכסים בלתי מוחשיים של מנפיק סדרת אג"ח בסך המאזן הכספי של אותו מנפיק, על פי המידע המפורסם בדוחות הכספיים של השנתיים של המנפיק.

**"תשואת דיבידנד"** - יחס המתקבל כתוצאה מחלוקת שווי שוק של נייר ערך בדיבידנד המצטבר של החברה בארבעת הרבעונים המדווחים האחרונים שלה, על פי המידע המפורסם בדוחות הכספיים של החברה.

**"אחריות תאגידית (ESG)"** - אסטרטגיה שבמסגרתה מנפיקי ניירות ערך גיבשו מדיניות סדורה ומנהלים באופן שוטף את חשיפותיהם לסיכונים סביבתיים, חברתיים וממשל תאגידי.

**"שיעור ייצוג נשי בדירקטוריון"** - יחס המבטא את מספר הנשים בדירקטוריון של תאגיד מסוים ביחס לכלל הדירקטורים בתאגיד זה.

## תנאי סף כלליים במדדים

במדדי אינדקס המפורטים במסמך זה יכללו רק ניירות ערך אשר יעמדו בתנאי הסף הכלליים הנדרשים על מנת להיכלל במאגר אינדקס מניות (להלן: "**מאגר המניות**"), בנוסף לתנאי הסף הספציפיים המוגדרים לכל מדד ומפורטים להלן. נגרע נייר ערך ממאגר המניות, יגרע נייר ערך מכל המדדים בהם כלול נייר ערך במועד גריעתו ממאגר המניות.

במועד עדכון מאגר המניות יכללו ניירות ערך, אשר במועד הקובע לעדכון המדדים, יתקיימו לגביהם התנאים המצטברים הבאים:

- שערי ניירות הערך מפורסמים על ידי בורסות כהגדרתן ו/או במערכות מידע פיננסי כהגדרתן.
- השווי ההוגן של הנכסים הפיננסיים מחושב על פי מידע פומבי בלבד.
- ניירות הערך רשומים למסחר בבורסות כהגדרתן ועומדים בתנאי הרישום של הבורסות כאמור.
- כל עוד לא נקבע מפורשות אחרת, נייר ערך עשוי להתווסף למאגר או למדד מסוים רק במידה והשלים לכל הפחות 30 ימי מסחר בבורסות כאמור.
- ניירות הערך אינם נכללים ברשימות "דלי סחירות" ו/או "שימור" ו/או "מסחר מחוץ לדלפק (OTC)" ואינם נמצאים בהשעיית מסחר ו/או בהליך סופי של מחיקה ממסחר.
- ניירות הערך אינם מסוג תעודות מניה אמריקאיות (ADR) ללא חסות, אגרות חוב המירות למניות, כתבי אופציות או זכויות.
- ניירות הערך אינם של מנפיקים הנמנים על רשימת חברות שהוטלו עליהן סנקציות השקעה בידי ממשלת ארה"ב (לרבות צו נשיא ארה"ב 13959 האוסר השקעה בחברות סיניות מסוימות) ו/או האיחוד האירופי ו/או ממשלת בריטניה.
- ועדת המדדים רשאית לקבוע כי ניירות הערך של מנפיק, אשר מכר או הפסיק את עסקיו הקודמים וטרם החל בפעילות חדשה ו/או אשר פעילותו העיקרית אינה נכללת בתחומי הפעילות המוגדרים בסיווג iNDEX-Tree ו/או אשר תחום פעילותו העיקרי אינו מוסדר מבחינה רגולטורית, לא יכללו במאגר או במדד מסוים.
- ועדת המדדים רשאית לקבוע כי ניירות הערך של מנפיק, אשר לא רשם רווח נקי שנתי חיובי במהלך שנה אחת לכל הפחות מבין 3 השנים שקדמו לעדכון המדד, לא יכללו במאגר או במדד מסוים.
- ועדת המדדים רשאית לקבוע כי תנאי הסחירות והמילות בנייר ערך מסוים אינם מאפשרים לכלול אותו במאגר או במדד מסוים.
- שווי שוק החזקות הציבור של ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-10 מיליון דולר ארה"ב.
- שיעור החזקות הציבור של ניירות הערך במועד הקובע אינו פוחת מ-10%.

## אינדקס בנקים ישראל



### תמצית המדד

המדד הינו מדד הבנצ'מרק של מניות הבנקים בישראל.

### מזהה המדד

סימול מדד: 2141.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות.
- ניירות הערך רשומים למסחר בבורסה בישראל.
- ניירות הערך נקובים בש"ח.
- מנפיקי ניירות הערך משייכים לישראל בהתאם לסיווג iINDEX-Geo.
- מנפיקי ניירות הערך מסווגים במגזר פעילות "בנקים", בהתאם לסיווג iINDEX-Tree.
- שווי שוק החזקות הציבור של ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-1 מיליארד ש"ח.
- שיעור החזקות הציבור של ניירות הערך במועד הקובע אינו פוחת מ-30%.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-1 מיליון ש"ח.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-5.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.
- \* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 10.

### עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: נייר ערך שנרשם למסחר אחרי המועד הקובע לעדכון הרכב המדד, עשוי להתווסף למדד בעדכון משקלות רבעוני במידה ושווי השוק הממוצע של נייר הערך במועד הקובע לעדכון המשקלות הרבעוני שווה או גבוה משווי השוק הממוצע של נייר ערך במיקום החיצוני במדד על פי דירוג שווי שוק ממוצע במועד הקובע כאמור, ובלבד שבמועד הקובע כאמור חלפו 60 ימים ממועד הרישום של נייר הערך בבורסה ונייר הערך עומד בכל תנאי הסף של המדד במועד הקובע כאמור. בעת צירוף נייר ערך למדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב מדד, לא יגרע מהמדד נייר ערך אחר עד למועד עדכון הרכב המדד הבא.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.

- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iINDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

### **חישוב המדד**

- תחילת פרסום: 13/04/2021.
- התחלת שערים היסטוריים: 02/08/2012.
- ערך בסיס: 814.73.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת ברוטו (GTR).
- מטבע חישוב: שקל חדש.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: בהתאם למפורט בפרק "תקרות משקל במדדי שווי שוק" להלן.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: אין.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: אין.

### **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

### תמצית המדד

המדד כולל את 5 מניות הבנקים הגדולים בישראל, תוך מתן משקל אחיד לכל המניות הנכללות במדד.

### מזהה המדד

סימול מדד: 2139.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות.
- ניירות הערך רשומים למסחר בבורסה בישראל.
- ניירות הערך נקובים בש"ח.
- מנפיקי ניירות הערך משייכים לישראל בהתאם לסיווג iINDEX-Geo.
- מנפיקי ניירות הערך מסווגים במגזר פעילות "בנקים", בהתאם לסיווג iINDEX-Tree.
- שווי שוק החזקות הציבור של ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-250 מיליון ש"ח.
- שיעור החזקות הציבור של ניירות הערך במועד הקובע אינו פוחת מ-20%.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-250,000 ש"ח.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-5.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.

\* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 5.

### עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: נייר ערך שנרשם למסחר אחרי המועד הקובע לעדכון הרכב המדד, עשוי להתווסף למדד בעדכון משקלות רבעוני במידה ושווי השוק הממוצע של נייר הערך במועד הקובע לעדכון המשקלות הרבעוני שווה או גבוה משווי השוק הממוצע של נייר ערך במיקום החיצוני במדד על פי דירוג שווי שוק ממוצע במועד הקובע כאמור, ובלבד שבמועד הקובע כאמור חלפו 60 ימים ממועד הרישום של נייר הערך בבורסה ונייר הערך עומד בכל תנאי הסף של המדד במועד הקובע כאמור. בעת צירוף נייר ערך למדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב מדד, לא יגרע מהמדד נייר ערך אחר עד למועד עדכון הרכב המדד הבא.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iINDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

## חישוב המדד

- תחילת פרסום: 04/06/2020.
- התחלת שערים היסטוריים: 02/08/2012.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת ברוטו (GTR).
- מטבע חישוב: שקל חדש.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד משקל אחיד.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: 22.5%.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 10%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: אין.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: אין.

## שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

### תמצית המדד

המדד כולל את 5 מניות חברות הביטוח הגדולות בישראל.

### מזהה המדד

סימול מדד: 2113.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות.
- ניירות הערך רשומים למסחר בבורסה בישראל.
- ניירות הערך נקובים בש"ח.
- מנפיקי ניירות הערך משויכים לישראל בהתאם לסיווג iINDEX-Geo.
- מנפיקי ניירות הערך מסווגים במגזר הפעילות "ביטוח", בהתאם לסיווג iINDEX-Tree.
- שווי שוק החזקות הציבור של ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-250 מיליון ש"ח.
- שיעור החזקות הציבור של ניירות הערך במועד הקובע אינו פוחת מ-20%.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-250,000 ש"ח.
- מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 5.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.

### עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: נייר ערך שנרשם למסחר אחרי המועד הקובע לעדכון הרכב המדד, עשוי להתווסף למדד בעדכון משקלות רבעוני במידה ושווי השוק הממוצע של נייר הערך במועד הקובע לעדכון המשקלות הרבעוני שווה או גבוה משווי השוק הממוצע של נייר ערך במיקום החציוני במדד על פי דירוג שווי שוק ממוצע במועד הקובע כאמור, ובלבד שבמועד הקובע כאמור חלפו 60 ימים ממועד הרישום של נייר הערך בבורסה ונייר הערך עומד בכל תנאי הסף של המדד במועד הקובע כאמור. בעת צירוף נייר ערך למדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב מדד, לא יגרע מהמדד נייר ערך אחר עד למועד עדכון הרכב המדד הבא.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iINDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

## **חישוב המדד**

- תחילת פרסום: 18/09/2023.
- התחלת שערים היסטוריים: 05/08/2012.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת ברוטו (GTR).
- מטבע חישוב: שקל חדש.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: בהתאם למפורט בפרק "תקריות משקל במדדי שווי שוק" להלן.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: אין.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: אין.

## **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.



### תמצית המדד

המדד כולל מניות של חברות ביטוח ישראליות, תוך מתן משקל אחיד לכל המניות הנכללות במדד.

### מזהה המדד

סימול מדד: 2140.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות.
- ניירות הערך רשומים למסחר בבורסה בישראל.
- ניירות הערך נקובים בש"ח.
- מנפיקי ניירות הערך משייכים לישראל בהתאם לסיווג iINDEX-Geo.
- מנפיקי ניירות הערך מסווגים במגזר פעילות "ביטוח", בהתאם לסיווג iINDEX-Tree.
- שווי שוק החזקות הציבור של ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-250 מיליון ש"ח.
- שיעור החזקות הציבור של ניירות הערך במועד הקובע אינו פוחת מ-20%.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-250,000 ש"ח.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-5.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.

\* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 10.

### עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: נייר ערך שנרשם למסחר אחרי המועד הקובע לעדכון הרכב המדד, עשוי להתווסף למדד בעדכון משקלות רבעוני במידה ושווי השוק הממוצע של נייר הערך במועד הקובע לעדכון המשקלות הרבעוני שווה או גבוה משווי השוק הממוצע של נייר ערך במיקום החיצוני במדד על פי דירוג שווי שוק ממוצע במועד הקובע כאמור, ובלבד שבמועד הקובע כאמור חלפו 60 ימים ממועד הרישום של נייר הערך בבורסה ונייר הערך עומד בכל תנאי הסף של המדד במועד הקובע כאמור. בעת צירוף נייר ערך למדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב מדד, לא יגרע מהמדד נייר ערך אחר עד למועד עדכון הרכב המדד הבא.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iINDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

## חישוב המדד

- תחילת פרסום: 04/06/2020.
- התחלת שערים היסטוריים: 02/08/2012.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת ברוטו (GTR).
- מטבע חישוב: שקל חדש.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד משקל אחיד.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: 22.5%.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 5%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: אין.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: אין.

## שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

## תמצית המדד

המדד כולל מניות של בנקים ישראלים ושל חברות ביטוח ישראליות הנסחרות בבורסה בישראל.

## מזהה המדד

סימול מדד: 2114.

## הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות.
- ניירות הערך רשומים למסחר בבורסה בישראל.
- ניירות הערך נקובים בש"ח.
- מנפיקי ניירות הערך משויכים לישראל בהתאם לסיווג iNDEX-Geo.
- מנפיקי ניירות הערך מסווגים באחד ממגזרי הפעילות הבאים: "בנקים" או "ביטוח", בהתאם לסיווג iNDEX-Tree.
- שווי שוק החזקות הציבור של ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-75 מיליון ש"ח.
- שיעור החזקות הציבור של ניירות הערך במועד הקובע אינו פוחת מ-20%.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-50,000 ש"ח.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-10.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.

\* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 20.

## עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: נייר ערך שנרשם למסחר אחרי המועד הקובע לעדכון הרכב המדד, עשוי להתווסף למדד בעדכון משקלות רבעוני במידה ושווי השוק הממוצע של נייר הערך במועד הקובע לעדכון המשקלות הרבעוני שווה או גבוה משווי השוק הממוצע של נייר ערך במיקום החציוני במדד על פי דירוג שווי שוק ממוצע במועד הקובע כאמור, ובלבד שבמועד הקובע כאמור חלפו 60 ימים ממועד הרישום של נייר הערך בבורסה ונייר הערך עומד בכל תנאי הסף של המדד במועד הקובע כאמור. בעת צירוף נייר ערך למדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב מדד, לא יגרע מהמדד נייר ערך אחר עד למועד עדכון הרכב המדד הבא.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iNDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

## **חישוב המדד**

- תחילת פרסום: 06/08/2017.
- התחלת שיערים היסטוריים: 05/08/2012.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת ברוטו (GTR).
- מטבע חישוב: שקל חדש.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: 12%.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: משקלן המצרפי של כל המניות הנכללות במגזר פעילות מסוים לא יפחת מ-25% ממשקל המדד.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: אין.

## **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

### תמצית המדד

המדד כולל מניות של חברות ישראליות הנסחרות בבורסה בישראל ומתמחות באשראי חוץ בנקאי ובשירותים פיננסיים אחרים.

### מזהה המדד

סימול מדד: 2145.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות.
- ניירות הערך רשומים למסחר בבורסה בישראל.
- ניירות הערך נקובים בש"ח.
- מנפיקי ניירות הערך משויכים לישראל בהתאם לסיווג iNDEX-Geo.
- מנפיקי ניירות הערך מסווגים באחד ממגזרי הפעילות הבאים: "אשראי חוץ בנקאי" או "שירותים פיננסיים", בהתאם לסיווג iNDEX-Tree.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-10,000 ש"ח.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-10.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.
- \* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 40.

### עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: נייר ערך שנרשם למסחר אחרי המועד הקובע לעדכון הרכב המדד, עשוי להתווסף למדד בעדכון משקלות רבעוני במידה ושווי השוק הממוצע של נייר הערך במועד הקובע לעדכון המשקלות הרבעוני שווה או גבוה משווי השוק הממוצע של נייר ערך במיקום החציוני במדד על פי דירוג שווי שוק ממוצע במועד הקובע כאמור, ובלבד שבמועד הקובע כאמור חלפו 60 ימים ממועד הרישום של נייר הערך בבורסה ונייר הערך עומד בכל תנאי הסף של המדד במועד הקובע כאמור. בעת צירוף נייר ערך למדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב מדד, לא יגרע מהמדד נייר ערך אחר עד למועד עדכון הרכב המדד הבא.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iNDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

## **חישוב המדד**

- תחילת פרסום: 20/12/2020.
- התחלת שיערים היסטוריים: 17/12/2020.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת ברוטו (GTR).
- מטבע חישוב: שקל חדש.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: בהתאם למפורט בפרק "תקרות משקל במדדי שווי שוק" להלן.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: משקלן המצרפי של כל המניות הנכללות במגזר פעילות "אשראי חוץ בנקאי" לא יפחת מ-60% ממשקל המדד.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: אין.

## **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

### תמצית המדד

המדד כולל מניות של חברות ישראליות הנסחרות בישראל ומסווגות על ידי הבורסה בענף "בנקים", "ביטוח" או "שירותים פיננסיים", כאשר במועד הקובע לעדכון המדד מבוצע איזון ענפי של משקל המדד בין 3 הענפים, כך שכל ענף יהווה 1/3 ממשקל המדד.

### מזהה המדד

סימול מדד: 2146.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות.
- ניירות הערך רשומים למסחר בבורסה בישראל.
- ניירות הערך נקובים בש"ח.
- מנפיקי ניירות הערך משויכים לישראל בהתאם לסיווג iNDEX-Geo.
- מנפיקי ניירות הערך מסווגים על ידי הבורסה בענף "בנקים", "ביטוח" או "שירותים פיננסיים".
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-10,000 ש"ח.
- מספר ניירות הערך במדד אינו מוגבל.

### עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: נייר ערך שנרשם למסחר אחרי המועד הקובע לעדכון הרכב המדד, עשוי להתווסף למדד בעדכון משקלות רבעוני במידה ושווי השוק הממוצע של נייר הערך במועד הקובע לעדכון המשקלות הרבעוני שווה או גבוה משווי השוק הממוצע של נייר ערך במיקום החציוני במדד על פי דירוג שווי שוק ממוצע במועד הקובע כאמור, ובלבד שבמועד הקובע כאמור חלפו 60 ימים ממועד הרישום של נייר הערך בבורסה ונייר הערך עומד בכל תנאי הסף של המדד במועד הקובע כאמור. בעת צירוף נייר ערך למדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב מדד, לא יגרע מהמדד נייר ערך אחר עד למועד עדכון הרכב המדד הבא.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iNDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

### חישוב המדד

- תחילת פרסום: 19/04/2021.
- התחלת שערים היסטוריים: 30/03/2017.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת ברוטו (GTR).
- מטבע חישוב: שקל חדש.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: 8%.

- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: משקלן המצרפי של כל המניות הנכללות בענף בורסה מסוים לא יעלה על שליש ממשקל המדד.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: אין.

#### **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.



## תמצית המדד

המדד כולל מניות של חברות ישראליות הנסחרות בבורסה בישראל ומסווגות על ידי הבורסה בתת-ענף "נדל"ן מניב בישראל" או "בנייה", כאשר במועד הקובע לעדכון המדד משקלן של מניות נדל"ן מניב בישראל יעמוד 2/3 ממשקל המדד ומניות בנייה על 1/3 ממשקל המדד.

## מזהה המדד

סימול מדד: 2129.

## הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה, יחידות השתתפות בשותפות מוגבלת או יחידות השתתפות בקרן ריט (REIT).
- ניירות הערך רשומים למסחר בבורסה בישראל.
- ניירות הערך נקובים בש"ח.
- מנפיקי ניירות הערך משויכים לישראל בהתאם לסיווג INDEX-Geo.
- מנפיקי ניירות הערך מסווגים על ידי הבורסה בתת-ענף "נדל"ן מניב בישראל" או "בנייה".
- שווי שוק החזקות הציבור של ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-75 מיליון ש"ח.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-10,000 ש"ח.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-15.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך המסווגים בתת-ענף "נדל"ן מניב בישראל" במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-10.
- סינון ניירות הערך המסווגים בתת-ענף "נדל"ן מניב בישראל" במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד המסווגים בתת-ענף "נדל"ן מניב בישראל" במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך המסווגים בתת-ענף "בנייה" במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-5.
- סינון ניירות הערך המסווגים בתת-ענף "בנייה" במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד המסווגים בתת-ענף "בנייה" במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.
- \* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 40, מספר מנפיקי ניירות הערך המסווגים בתת-ענף "נדל"ן מניב בישראל" במועד הקובע לא יעלה על 25 ומספר מנפיקי ניירות הערך המסווגים בתת-ענף "בנייה" במועד הקובע לא יעלה על 15.

## **עדכונים במדד**

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: נייר ערך שנרשם למסחר אחרי המועד הקובע לעדכון הרכב המדד, עשוי להתווסף למדד בעדכון משקלות רבעוני במידה ושווי השוק הממוצע של נייר הערך במועד הקובע לעדכון המשקלות הרבעוני שווה או גבוה משווי השוק הממוצע של נייר ערך במיקום החציוני במדד על פי דירוג שווי שוק ממוצע במועד הקובע כאמור, ובלבד שבמועד הקובע כאמור חלפו 60 ימים ממועד הרישום של נייר הערך בבורסה ונייר הערך עומד בכל תנאי הסף של המדד במועד הקובע כאמור. בעת צירוף נייר ערך למדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב מדד, לא יגרע מהמדד נייר ערך אחר עד למועד עדכון הרכב המדד הבא.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iINDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

## **חישוב המדד**

- תחילת פרסום: 15/11/2023.
- התחלת שיערים היסטוריים: 03/05/2018.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת ברוטו (GTR).
- מטבע חישוב: שקל חדש.
- מנגנון קביעת משקלות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: 4%.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: משקלן המצרפי של כל המניות המסווגות "נדל"ן מניב בישראל" יעמוד על 2/3 ממשקל המדד ומשקלן המצרפי של כל המניות המסווגות "בנייה" יעמוד על 1/3 ממשקל המדד.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקלות: אין.

## **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

### תמצית המדד

המדד כולל מניות של חברות ישראליות הנסחרות בבורסה בישראל ועיקר פעילותן בתחום הנדל"ן למגורים בישראל.

### מזהה המדד

סימול מדד: 2118.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה, יחידות השתתפות בשותפות מוגבלת או יחידות השתתפות בקרן ריט (REIT).
- ניירות הערך רשומים למסחר בבורסה בישראל.
- ניירות הערך נקובים בש"ח.
- מנפיקי ניירות הערך משיכים לישראל בהתאם לסיווג iINDEX-Geo.
- מנפיקי ניירות הערך הם בעלי שיעור הכנסה שנתית שעולה על 50% מתחום נדל"ן למגורים בישראל על פי הדוח התקופתי האחרון או שיותר ממחצית מנכסיהם המאזני מקורו מתחום נדל"ן למגורים בישראל.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-10,000 ש"ח.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-10.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.
- \* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 40.

### עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: נייר ערך שנרשם למסחר אחרי המועד הקובע לעדכון הרכב המדד, עשוי להתווסף למדד בעדכון משקלות רבעוני במידה ושווי השוק הממוצע של נייר הערך במועד הקובע לעדכון המשקלות הרבעוני שווה או גבוה משווי השוק הממוצע של נייר ערך במיקום החיצוני במדד על פי דירוג שווי שוק ממוצע במועד הקובע כאמור, ובלבד שבמועד הקובע כאמור חלפו 60 ימים ממועד הרישום של נייר הערך בבורסה ונייר הערך עומד בכל תנאי הסף של המדד במועד הקובע כאמור. בעת צירוף נייר ערך למדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב מדד, לא יגרע מהמדד נייר ערך אחר עד למועד עדכון הרכב המדד הבא.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iINDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

## **חישוב המדד**

- תחילת פרסום: 06/08/2017.
- התחלת שערים היסטוריים: 09/02/2017.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת ברוטו (GTR).
- מטבע חישוב: שקל חדש.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: בהתאם למפורט בפרק "תקריות משקל במדדי שווי שוק" להלן.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: אין.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: אין.

## **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

### תמצית המדד

המדד כולל מניות של חברות ישראליות הנסחרות בבורסה בישראל ועיקר פעילותן בתחום נדל"ן משרדים ומרכזי קניות בישראל.

### מזהה המדד

סימול מדד: 2117.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה, יחידות השתתפות בשותפות מוגבלת או יחידות השתתפות בקרן ריט (REIT).
- ניירות הערך רשומים למסחר בבורסה בישראל.
- ניירות הערך נקובים בש"ח.
- מנפיקי ניירות הערך משייכים לישראל בהתאם לסיווג iINDEX-Geo.
- מנפיקי ניירות הערך הם בעלי שיעור הכנסה שנתית שעולה על 50% מתחום נדל"ן משרדים ומרכזי קניות בישראל על פי הדוח התקופתי האחרון או שיותר ממחצית מנכסיהם המאזני מקורו מתחום נדל"ן משרדים ומרכזי קניות בישראל.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-10,000 ש"ח.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-10.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.
- \* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 40.

### עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: נייר ערך שנרשם למסחר אחרי המועד הקובע לעדכון הרכב המדד, עשוי להתווסף למדד בעדכון משקלות רבעוני במידה ושווי השוק הממוצע של נייר הערך במועד הקובע לעדכון המשקלות הרבעוני שווה או גבוה משווי השוק הממוצע של נייר ערך במיקום החיצוני במדד על פי דירוג שווי שוק ממוצע במועד הקובע כאמור, ובלבד שבמועד הקובע כאמור חלפו 60 ימים ממועד הרישום של נייר הערך בבורסה ונייר הערך עומד בכל תנאי הסף של המדד במועד הקובע כאמור. בעת צירוף נייר ערך למדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב מדד, לא יגרע מהמדד נייר ערך אחר עד למועד עדכון הרכב המדד הבא.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iINDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

## חישוב המדד

- תחילת פרסום: 06/08/2017.
- התחלת שערים היסטוריים: 02/08/2012.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת ברוטו (GTR).
- מטבע חישוב: שקל חדש.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: בהתאם למפורט בפרק "תקרות משקל במדדי שווי שוק" להלן.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: אין.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: אין.

## שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

## אינדקס בנייה ישראל - פקטור מינוף פיננסי נמוך



### תמצית המדד

המדד כולל מניות של חברות הנסחרות בבורסה בישראל ומסווגות על ידי הבורסה בתת-ענף "בנייה", כאשר במועד הקובע ניתן משקל עודף למניות בעלות שיעור גבוה של הון למאזן.

### מזהה המדד

סימול מדד: 2127.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה, יחידות השתתפות בשותפות מוגבלת או יחידות השתתפות בקרן ריט (REIT).
- ניירות הערך רשומים למסחר בבורסה בישראל.
- ניירות הערך נקובים בש"ח.
- מנפיקי ניירות הערך מסווגים על ידי הבורסה בתת-ענף "בנייה".
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-10,000 ש"ח.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-20.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.
- \* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 60.

### עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: נייר ערך שנרשם למסחר אחרי המועד הקובע לעדכון הרכב המדד, עשוי להתווסף למדד בעדכון משקלות רבעוני במידה ושווי השוק הממוצע של נייר הערך במועד הקובע לעדכון המשקלות הרבעוני שווה או גבוה משווי השוק הממוצע של נייר ערך במיקום החציוני במדד על פי דירוג שווי שוק ממוצע במועד הקובע כאמור, ובלבד שבמועד הקובע כאמור חלפו 60 ימים ממועד הרישום של נייר הערך בבורסה ונייר הערך עומד בכל תנאי הסף של המדד במועד הקובע כאמור. בעת צירוף נייר ערך למדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב מדד, לא יגרע מהמדד נייר ערך אחר עד למועד עדכון הרכב המדד הבא.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iNDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

### חישוב המדד

- תחילת פרסום: 16/11/2023.

- התחלת שיערים היסטוריים: 02/06/2020.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת ברוטו (GTR).
- מטבע חישוב: שקל חדש.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: בהתאם למפורט בפרק "תקרות משקל במדדי שווי שוק" להלן.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: אין.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: (1) תיקנון פקטור מגבלת משקל של ניירות ערך במדד בהתאם למינוף הפיננסי של מנפיק נייר הערך ביחס למינוף הפיננסי החציוני של כלל מנפיקי ניירות הערך במדד: 0.75 עד 1.5. (2) תיקנון פקטור מגבלת משקל של ניירות ערך במדד במקרה ומנפיק נייר הערך בעל שיעור הכנסה שנתית שעולה על 50% מחוץ לישראל על פי הדוח התקופתי האחרון - פקטור 0.5X.

#### **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.



### תמצית המדד

המדד כולל מניות של חברות ישראליות הנסחרות בבורסה בישראל ומתמחות בסקטורים הבאים: צריכה בסיסית או צריכה מחזורית.

### מזהה המדד

סימול מדד: 2133.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה או יחידות השתתפות בשותפות מוגבלת.
- ניירות הערך רשומים למסחר בבורסה בישראל.
- ניירות הערך נקובים בש"ח.
- מנפיקי ניירות הערך משויכים לישראל בהתאם לסיווג iINDEX-Geo.
- מנפיקי ניירות הערך מסווגים באחד מהסקטורים הכלכליים הבאים: "צריכה בסיסית" או "צריכה מחזורית", בהתאם לסיווג iINDEX-Tree.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-10,000 ש"ח.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-20.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.
- \* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 60.

### עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: נייר ערך שנרשם למסחר אחרי המועד הקובע לעדכון הרכב המדד, עשוי להתווסף למדד בעדכון משקלות רבעוני במידה ושווי השוק הממוצע של נייר הערך במועד הקובע לעדכון המשקלות הרבעוני שווה או גבוה משווי השוק הממוצע של נייר ערך במיקום החציוני במדד על פי דירוג שווי שוק ממוצע במועד הקובע כאמור, ובלבד שבמועד הקובע כאמור חלפו 60 ימים ממועד הרישום של נייר הערך בבורסה ונייר הערך עומד בכל תנאי הסף של המדד במועד הקובע כאמור. בעת צירוף נייר ערך למדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב מדד, לא יגרע מהמדד נייר ערך אחר עד למועד עדכון הרכב המדד הבא.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iINDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

## **חישוב המדד**

- תחילת פרסום: 13/02/2020.
- התחלת שערים היסטוריים: 02/08/2012.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת ברוטו (GTR).
- מטבע חישוב: שקל חדש.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: בהתאם למפורט בפרק "תקריות משקל במדדי שווי שוק" להלן.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: אין.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: אין.

## **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

### תמצית המדד

המדד כולל מניות של חברות ישראליות הנסחרות בבורסה בישראל ומתמחות בסקטור צריכה בסיסית.

### מזהה המדד

סימול מדד: 2137.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה או יחידות השתתפות בשותפות מוגבלת.
- ניירות הערך רשומים למסחר בבורסה בישראל.
- ניירות הערך נקובים בש"ח.
- מנפיקי ניירות הערך משויכים לישראל בהתאם לסיווג iINDEX-Geo.
- מנפיקי ניירות הערך מסווגים בסקטור כלכלי "צריכה בסיסית", בהתאם לסיווג iINDEX-Tree.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-10,000 ש"ח.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-10.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.
- \* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 40.

### עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: נייר ערך שנרשם למסחר אחרי המועד הקובע לעדכון הרכב המדד, עשוי להתווסף למדד בעדכון משקלות רבעוני במידה ושווי השוק הממוצע של נייר הערך במועד הקובע לעדכון המשקלות הרבעוני שווה או גבוה משווי השוק הממוצע של נייר ערך במיקום החיצוני במדד על פי דירוג שווי שוק ממוצע במועד הקובע כאמור, ובלבד שבמועד הקובע כאמור חלפו 60 ימים ממועד הרישום של נייר הערך בבורסה ונייר הערך עומד בכל תנאי הסף של המדד במועד הקובע כאמור. בעת צירוף נייר ערך למדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב מדד, לא יגרע מהמדד נייר ערך אחר עד למועד עדכון הרכב המדד הבא.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iINDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

### חישוב המדד

- תחילת פרסום: 04/06/2020.
- התחלת שיערים היסטוריים: 31/12/2014.
- ערך בסיס: 1,000.

- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת ברוטו (GTR).
- מטבע חישוב: שקל חדש.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: בהתאם למפורט בפרק "תקריות משקל במדדי שווי שוק" להלן.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: אין.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: אין.

#### **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

### תמצית המדד

המדד כולל מניות של חברות ישראליות הנסחרות בבורסה בישראל ומתמחות בסקטור צריכה מחזורית.

### מזהה המדד

סימול מדד: 2138.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה או יחידות השתתפות בשותפות מוגבלת.
- ניירות הערך רשומים למסחר בבורסה בישראל.
- ניירות הערך נקובים בש"ח.
- מנפיקי ניירות הערך משייכים לישראל בהתאם לסיווג iINDEX-Geo.
- מנפיקי ניירות הערך מסווגים בסקטור כלכלי "צריכה מחזורית", בהתאם לסיווג iINDEX-Tree.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-10,000 ש"ח.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-10.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.
- \* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 40.

### עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: נייר ערך שנרשם למסחר אחרי המועד הקובע לעדכון הרכב המדד, עשוי להתווסף למדד בעדכון משקלות רבעוני במידה ושווי השוק הממוצע של נייר הערך במועד הקובע לעדכון המשקלות הרבעוני שווה או גבוה משווי השוק הממוצע של נייר ערך במיקום החיצוני במדד על פי דירוג שווי שוק ממוצע במועד הקובע כאמור, ובלבד שבמועד הקובע כאמור חלפו 60 ימים ממועד הרישום של נייר הערך בבורסה ונייר הערך עומד בכל תנאי הסף של המדד במועד הקובע כאמור. בעת צירוף נייר ערך למדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב מדד, לא יגרע מהמדד נייר ערך אחר עד למועד עדכון הרכב המדד הבא.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iINDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

### חישוב המדד

- תחילת פרסום: 04/06/2020.
- התחלת שיערים היסטוריים: 31/12/2014.
- ערך בסיס: 1,000.

- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת ברוטו (GTR).
- מטבע חישוב: שקל חדש.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: בהתאם למפורט בפרק "תקריות משקל במדדי שווי שוק" להלן.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: אין.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: אין.

#### **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

### תמצית המדד

המדד כולל מניות של חברות ישראליות הנסחרות בבורסה בישראל ומתמחות בתחומי קמעונאות כללית או קמעונאות מזון ומוצרי יסוד.

### מזהה המדד

סימול מדד: 2136.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה או יחידות השתתפות בשותפות מוגבלת.
- ניירות הערך רשומים למסחר בבורסה בישראל.
- ניירות הערך נקובים בש"ח.
- מנפיקי ניירות הערך משייכים לישראל בהתאם לסיווג iINDEX-Geo.
- מנפיקי ניירות הערך מסווגים באחד ממגזרי הפעילות הבאים: "קמעונאות כללית" או "קמעונאות מזון ומוצרי יסוד", בהתאם לסיווג iINDEX-Tree.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-10,000 ש"ח.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-10.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.
- \* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 40.

### עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: נייר ערך שנרשם למסחר אחרי המועד הקובע לעדכון הרכב המדד, עשוי להתווסף למדד בעדכון משקלות רבעוני במידה ושווי השוק הממוצע של נייר הערך במועד הקובע לעדכון המשקלות הרבעוני שווה או גבוה משווי השוק הממוצע של נייר ערך במיקום החציוני במדד על פי דירוג שווי שוק ממוצע במועד הקובע כאמור, ובלבד שבמועד הקובע כאמור חלפו 60 ימים ממועד הרישום של נייר הערך בבורסה ונייר הערך עומד בכל תנאי הסף של המדד במועד הקובע כאמור. בעת צירוף נייר ערך למדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב מדד, לא יגרע מהמדד נייר ערך אחר עד למועד עדכון הרכב המדד הבא.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iINDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

### חישוב המדד

- תחילת פרסום: 04/06/2020.

- התחלת שיערים היסטוריים: 31/12/2014.
  - ערך בסיס: 1,000.
  - אופן החישוב: מדד תשואה כוללת ברוטו (GTR).
  - מטבע חישוב: שקל חדש.
  - מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
  - תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: בהתאם למפורט בפרק "תקריות משקל במדדי שווי שוק" להלן.
  - משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
  - תקרת משקל ענפית במועד הקובע: אין.
  - פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: אין.
- שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**
- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
  - האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.



### תמצית המדד

המדד כולל מניות של חברות ישראליות הנסחרות בבורסה בישראל ומתמחות בתחומים הבאים: "יצרני מזון", "משקאות קלים", "משקאות אלכוהולים" או "קמעונאות מזון ומוצרי יסוד".

### מזהה המדד

סימול מדד: 2135.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה או יחידות השתתפות בשותפות מוגבלת.
  - ניירות הערך רשומים למסחר בבורסה בישראל.
  - ניירות הערך נקובים בש"ח.
  - מנפיקי ניירות הערך משייכים לישראל בהתאם לסיווג iNDEX-Geo.
  - מנפיקי ניירות הערך מסווגים באחת מקבוצות ההתמחות הענפית הבאות: "יצרני מזון", "משקאות קלים", "משקאות אלכוהוליים" או "קמעונאות מזון ומוצרי יסוד", בהתאם לסיווג iNDEX-Tree.
  - התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-10,000 ש"ח.
  - ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-10.
  - סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.
- \* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 30.

### עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: נייר ערך שנרשם למסחר אחרי המועד הקובע לעדכון הרכב המדד, עשוי להתווסף למדד בעדכון משקלות רבעוני במידה ושווי השוק הממוצע של נייר הערך במועד הקובע לעדכון המשקלות הרבעוני שווה או גבוה משווי השוק הממוצע של נייר ערך במיקום החציוני במדד על פי דירוג שווי שוק ממוצע במועד הקובע כאמור, ובלבד שבמועד הקובע כאמור חלפו 60 ימים ממועד הרישום של נייר הערך בבורסה ונייר הערך עומד בכל תנאי הסף של המדד במועד הקובע כאמור. בעת צירוף נייר ערך למדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב מדד, לא יגרע מהמדד נייר ערך אחר עד למועד עדכון הרכב המדד הבא.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iNDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

### חישוב המדד

- תחילת פרסום: 10/05/2020.

- התחלת שיערים היסטוריים: 01/01/2018.
  - ערך בסיס: 1,000.
  - אופן החישוב: מדד תשואה כוללת ברוטו (GTR).
  - מטבע חישוב: שקל חדש.
  - מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
  - תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: בהתאם למפורט בפרק "תקריות משקל במדדי שווי שוק" להלן.
  - משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
  - תקרת משקל ענפית במועד הקובע: אין.
  - פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: אין.
- שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**
- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
  - האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

### תמצית המדד

המדד כולל מניות של חברות בעלות רווחיות עקבית לאורך זמן הנסחרות בבורסה בישראל, אשר סווגו על ידי הבורסה בענף "טכנולוגיה", תוך מתן משקל אחיד במועד הקובע לכל מניה במדד.

### מזהה המדד

סימול מדד: 2142.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה או יחידות השתתפות בשותפות מוגבלת.
- ניירות הערך רשומים למסחר בבורסה בישראל.
- ניירות הערך נקובים בש"ח.
- מנפיקי ניירות הערך הם בעלי זיקה לישראל בהתאם לעקרונות המפורטים בסיווג iINDEX-Geo.
- מנפיקי ניירות הערך מסווגים על ידי הבורסה בתל-אביב בענף "טכנולוגיה".
- מנפיקי ניירות הערך רשמו רווח נקי שנתי חיובי במהלך שנתיים מתוך 3 השנים שקדמו למועד הקובע לעדכון הרכב המדד או לחילופין, ב-3 מתוך 5 השנים שקדמו למועד הקובע לעדכון הרכב המדד.
- שווי שוק החזקות הציבור של ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-250 מיליון ש"ח.
- שיעור החזקות הציבור של ניירות הערך במועד הקובע אינו פוחת מ-20%.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-50,000 ש"ח.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-15.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.

\* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 30.

### עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: נייר ערך שנרשם למסחר אחרי המועד הקובע לעדכון הרכב המדד, עשוי להתווסף למדד בעדכון משקלות רבעוני במידה ושווי השוק הממוצע של נייר הערך במועד הקובע לעדכון המשקלות הרבעוני שווה או גבוה משווי השוק הממוצע של נייר ערך במיקום החיצוני במדד על פי דירוג שווי שוק ממוצע במועד הקובע כאמור, ובלבד שבמועד הקובע כאמור חלפו 60 ימים ממועד הרישום של נייר הערך בבורסה ונייר הערך עומד בכל תנאי הסף של המדד במועד הקובע כאמור. בעת צירוף נייר ערך למדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב מדד, לא יגרע מהמדד נייר ערך אחר עד למועד עדכון הרכב המדד הבא.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.

- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iNDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

### **חישוב המדד**

- תחילת פרסום: 25/06/2020.
- התחלת שערים היסטוריים: 07/08/2014.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת ברוטו (GTR).
- מטבע חישוב: שקל חדש.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד משקל אחיד.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: 10%.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: אין.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: אין.

### **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

### תמצית המדד

המדד כולל מניות של חברות ישראליות הנסחרות בבורסה בישראל ומתמחות בסקטור תעשייה.

### מזהה המדד

סימול מדד: 2116.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה או יחידות השתתפות בשותפות מוגבלת.
- ניירות הערך רשומים למסחר בבורסה בישראל.
- ניירות הערך נקובים בש"ח.
- מנפיקי ניירות הערך משויכים לישראל בהתאם לסיווג iINDEX-Geo.
- מנפיקי ניירות הערך מסווגים בסקטור כלכלי "תעשייה", בהתאם לסיווג iINDEX-Tree.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-10,000 ש"ח.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-20.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.
- \* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 60.

### עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: נייר ערך שנרשם למסחר אחרי המועד הקובע לעדכון הרכב המדד, עשוי להתווסף למדד בעדכון משקלות רבעוני במידה ושווי השוק הממוצע של נייר הערך במועד הקובע לעדכון המשקלות הרבעוני שווה או גבוה משווי השוק הממוצע של נייר ערך במיקום החיצוני במדד על פי דירוג שווי שוק ממוצע במועד הקובע כאמור, ובלבד שבמועד הקובע כאמור חלפו 60 ימים ממועד הרישום של נייר הערך בבורסה ונייר הערך עומד בכל תנאי הסף של המדד במועד הקובע כאמור. בעת צירוף נייר ערך למדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב מדד, לא יגרע מהמדד נייר ערך אחר עד למועד עדכון הרכב המדד הבא.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iINDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

### חישוב המדד

- תחילת פרסום: 19/07/2021.
- התחלת שיערים היסטוריים: 05/08/2017.
- ערך בסיס: 1,000.

- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת ברוטו (GTR).
- מטבע חישוב: שקל חדש.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: בהתאם למפורט בפרק "תקריות משקל במדדי שווי שוק" להלן.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: אין.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: אין.

#### **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

### תמצית המדד

המדד כולל מניות של חברות ישראליות הנסחרות בבורסה בישראל ופעילות בתחום התשתיות הלאומיות בישראל כהגדרתן בחוק התכנון והבניה.

המונח "תשתיות לאומיות" מוגדר בחוק התכנון והבניה, תשכ"ה-1965 ונכללים בו תתי התחומים הבאים: מתקני תשתית, שדה תעופה, נמל, מעגן, מתקן להתפלת מים, מתקני מים וביוב לרבות מאגרים, אתרי סילוק וטיפול בפסולת, מתקני תקשורת, תחנת כוח, מתקן אחסון נפט, גז ודלק, דרך, מתקני גז ומתקני גז"ן (גז טבעי נוזלי) כהגדרתם בסעיף 2 לחוק משק הגז הטבעי, תשס"ב-2002, אתרי כרייה וחציבה, חניון לעידוד השימוש בתחבורה הציבורית, תשתית תיירות ובית סוהר.

הסיווג של מנפיקי ניירות הערך למדד זה באמצעות התאמת תתי התחומים הנכללים בהגדרת תשתיות לאומיות לעיל לקבוצות ההתמחות הענפית המפורטות בסיווג iNDEX-Tree. עבור מנפיקי ניירות הערך שלא ניתן להסיק מהסיווג שלהם על התאמה כאמור לעיל, נבחנים בין היתר, תיאור עסקי החברה ופעילויות עיקריות בדוחות הכספיים ו/או בדוחות מיידים של החברה לצורך קביעה האם מדובר בחברה העוסקת בתחום "תשתיות לאומיות".

### מזהה המדד

סימול מדד: 2126.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות.
- ניירות הערך רשומים למסחר בבורסה בישראל.
- ניירות הערך נקובים בש"ח.
- מנפיקי ניירות הערך משויכים לישראל בהתאם לסיווג iNDEX-Geo.
- מנפיקי ניירות הערך מסווגים על ידי עורך המדד באחד מתתי התחומים הבאים: מיתקני תשתית, מיתקני גז ומיתקני גז"ן, שדה תעופה/נמל/מעגן, מיתקני תקשורת, אתרי כרייה וחציבה, תחנת כוח, אחסון נפט, גז ודלק, מיתקני מים, התפלה וביוב, אתרי סילוק וטיפול בפסולת, תשתיות תחבורה ציבורית, תשתיות תיירות, תשתיות שיטור וכליאה, בהתאם למפורט לעיל.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-10,000 ש"ח.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-20.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.
- \* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 50.

### עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.

- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: נייר ערך שנרשם למסחר אחרי המועד הקובע לעדכון הרכב המדד, עשוי להתווסף למדד בעדכון משקלות רבעוני במידה ושווי השוק הממוצע של נייר הערך במועד הקובע לעדכון המשקלות הרבעוני שווה או גבוה משווי השוק הממוצע של נייר ערך במיקום החציוני במדד על פי דירוג שווי שוק ממוצע במועד הקובע כאמור, ובלבד שבמועד הקובע כאמור חלפו 60 ימים ממועד הרישום של נייר הערך בבורסה ונייר הערך עומד בכל תנאי הסף של המדד במועד הקובע כאמור. בעת צירוף נייר ערך למדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב מדד, לא יגרע מהמדד נייר ערך אחר עד למועד עדכון הרכב המדד הבא.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iNDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

### **חישוב המדד**

- תחילת פרסום: 01/09/2019.
- התחלת שערים היסטוריים: 04/08/2016.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת ברוטו (GTR).
- מטבע חישוב: שקל חדש.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: 8%.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: משקלם המצרפי של כל ניירות הערך שסווגו בתתי התחומים הבאים: מיתקני תשתית, שדה תעופה/נמל/מעגן, תחנת כוח, מיתקני מים, התפלה וביוב, אתרי סילוק וטיפול בפסולת, לא יפחת מ-60% ממשקל המדד.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: אין.

### **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.



### תמצית המדד

המדד כולל מניות של חברות שנסחרות בישראל ומתמחות בתחומי הנדסה ובינוי, חומרי ורכיבי בנייה ובייצור תעשייתי לתחומי תשתיות ובינוי.

### מזהה המדד

סימול מדד: 2122.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות.
- ניירות הערך רשומים למסחר בבורסה בישראל.
- ניירות הערך נקובים בש"ח.
- מנפיקי ניירות הערך משויכים לישראל בהתאם לסיווג iNDEX-Geo.
- מנפיקי ניירות הערך מסווגים באחד ממגזרי הפעילות הבאים: "הנדסה ובינוי" או "חומרי ורכיבי בנייה", או באחת מקבוצות ההתמחות הענפית הבאות: "מוצרי אוויר והסקה", "ציוד ומוצרי בנייה" או "ציוד חשמלי ומערכות חשמל", בהתאם לסיווג iNDEX-Tree.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-10,000 ש"ח.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-10.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.
- \* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 40.

### עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: נייר ערך שנרשם למסחר אחרי המועד הקובע לעדכון הרכב המדד, עשוי להתווסף למדד בעדכון משקלות רבעוני במידה ושווי השוק הממוצע של נייר הערך במועד הקובע לעדכון המשקולות הרבעוני שווה או גבוה משווי השוק הממוצע של נייר ערך במיקום החיצוני במדד על פי דירוג שווי שוק ממוצע במועד הקובע כאמור, ובלבד שבמועד הקובע כאמור חלפו 60 ימים ממועד הרישום של נייר הערך בבורסה ונייר הערך עומד בכל תנאי הסף של המדד במועד הקובע כאמור. בעת צירוף נייר ערך למדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב מדד, לא יגרע מהמדד נייר ערך אחר עד למועד עדכון הרכב המדד הבא.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iNDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

## חישוב המדד

- תחילת פרסום: 19/07/2021.
- התחלת שערים היסטוריים: 05/08/2017.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת ברוטו (GTR).
- מטבע חישוב: שקל חדש.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: 8%.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: אין.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: אין.

## שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

### תמצית המדד

המדד כולל מניות של חברות ישראליות הנסחרות בבורסה בישראל ומתמחות בסקטור אנרגיה או בתשתיות אנרגיה.

### מזהה המדד

סימול מדד: 2112.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה או יחידות השתתפות בשותפות מוגבלת.
- ניירות הערך רשומים למסחר בבורסה בישראל.
- ניירות הערך נקובים בש"ח.
- מנפיקי ניירות הערך הם בעלי זיקה לישראל בהתאם לעקרונות המפורטים בסיווג iINDEX-Geo.
- מנפיקי ניירות הערך מסווגים בסקטור כלכלי "אנרגיה" או במגזר הפעילות "תשתיות אנרגיה", בהתאם לסיווג iINDEX-Tree.
- שווי שוק החזקות הציבור של ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-100 מיליון ש"ח.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-10,000 ש"ח.

### עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: נייר ערך שנרשם למסחר אחרי המועד הקובע לעדכון הרכב המדד, עשוי להתווסף למדד בעדכון משקלות רבעוני במידה ושווי השוק הממוצע של נייר הערך במועד הקובע לעדכון המשקלות הרבעוני שווה או גבוה משווי השוק הממוצע של נייר ערך במיקום החציוני במדד על פי דירוג שווי שוק ממוצע במועד הקובע כאמור, ובלבד שבמועד הקובע כאמור חלפו 60 ימים ממועד הרישום של נייר הערך בבורסה ונייר הערך עומד בכל תנאי הסף של המדד במועד הקובע כאמור. בעת צירוף נייר ערך למדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב מדד, לא יגרע מהמדד נייר ערך אחר עד למועד עדכון הרכב המדד הבא.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iINDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

## **חישוב המדד**

- תחילת פרסום: 14/09/2023.
- התחלת שערים היסטוריים: 02/08/2018.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת ברוטו (GTR).
- מטבע חישוב: שקל חדש.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: בהתאם למפורט בפרק "תקריות משקל במדדי שווי שוק" להלן.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: אין.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: אין.

## **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

## תמצית המדד

המדד כולל מניות של חברות ישראליות הנסחרות בבורסה בישראל ומתמחות בתחומי אנרגיה מתחדשת. המונח "אנרגיה מתחדשת" מתייחס לחברות המתמחות בהפקת אנרגיה שמקורה בתהליכים טבעיים מתמשכים, שאינם מתכלים כתוצאה מרתימת האנרגיה האצורה בהם. מקורות אנרגיה מתחדשים מבוססות על אנרגיית מים, אנרגיית רוח, אנרגיה סולארית, הפקת אנרגיה מתהליכים ביולוגים, אנרגיה גאותרמית שמקורה במאגר החום הפנימי של כדור הארץ ואנרגיית גאות ושפל כתוצאה מכוחות המשיכה של הירח והשמש, ונבדלים ממקורות אנרגיה כגון דלק מאובנים (נפט, פחם וגז טבעי), שהשימוש בהם כרוך בהקטנה משמעותית של מאגר האנרגיה הזמינה האצורה בהם.

## מזהה המדד

סימול מדד: 2143.

## הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה או יחידות השתתפות בשותפות מוגבלת.
- ניירות הערך רשומים למסחר בבורסה בישראל.
- ניירות הערך נקובים בש"ח.
- מנפיקי ניירות הערך משויכים לישראל בהתאם לסיווג iINDEX-Geo.
- מנפיקי ניירות הערך מסווגים באחת מקבוצות ההתמחות הענפית הבאות: "יצרני חשמל מאנרגיה חלופית" או "ציוד לאנרגיה מתחדשת", בהתאם לסיווג iINDEX-Tree.
- שווי שוק ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-150 מיליון ש"ח.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-10,000 ש"ח.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-10.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.
- \* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 30.

## עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: נייר ערך שנרשם למסחר אחרי המועד הקובע לעדכון הרכב המדד, עשוי להתווסף למדד בעדכון משקלות רבעוני במידה ושווי השוק הממוצע של נייר הערך במועד הקובע לעדכון המשקלות הרבעוני שווה או גבוה משווי השוק הממוצע של נייר ערך במיקום החציוני במדד על פי דירוג שווי שוק ממוצע במועד הקובע כאמור, ובלבד שבמועד הקובע כאמור חלפו 60 ימים ממועד הרישום של נייר הערך בבורסה ונייר הערך עומד בכל תנאי הסף של המדד במועד הקובע כאמור. בעת צירוף נייר ערך למדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב מדד, לא יגרע מהמדד נייר ערך אחר עד למועד עדכון הרכב המדד הבא.

- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iINDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

### **חישוב המדד**

- תחילת פרסום: 25/06/2020.
- התחלת שערים היסטוריים: 02/04/2018.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת ברוטו (GTR).
- מטבע חישוב: שקל חדש.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: בהתאם למפורט בפרק "תקריות משקל במדדי שווי שוק" להלן.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: אין.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: אין.

### **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? כן, המדד שואף לקיים יעד של אחריות סביבתית (Environment).
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? כן. בתנאי הסף של המדד קיימת דרישה כי רק חברות המתמחות בתחומי הפעילות "יצרני חשמל מאנרגיה חלופית" או "ציוד לאנרגיה מתחדשת" יכללו במדד.

### תמצית המדד

המדד עוקב אחר 120 החברות הישראליות בעלות שווי השוק הגבוה ביותר בבורסה בישראל.

### מזהה המדד

סימול מדד: 2123.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה, יחידות השתתפות בשותפות מוגבלת או יחידות השתתפות בקרן ריט (REIT).
- ניירות הערך רשומים למסחר בבורסה בישראל.
- ניירות הערך נקובים בש"ח.
- מנפיקי ניירות הערך הם בעלי זיקה לישראל בהתאם לעקרונות המפורטים בסיווג iINDEX-Geo.
- שווי שוק החזקות הציבור של ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-75 מיליון ש"ח.
- שיעור החזקות הציבור של ניירות הערך במועד הקובע אינו פוחת מ-20%.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-50,000 ש"ח.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\*.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.
- \* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 120.

### עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: חצי שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: נייר ערך שנרשם למסחר אחרי המועד הקובע לעדכון הרכב המדד, עשוי להתווסף למדד בעדכון משקלות רבעוני במידה ושווי השוק הממוצע של נייר הערך במועד הקובע לעדכון המשקלות הרבעוני שווה או גבוה משווי השוק של נייר ערך בעל דירוג שווי שוק ממוצע במקום ה-90 במדד במועד הקובע כאמור, ובלבד שבמועד הקובע כאמור חלפו 60 ימים ממועד הרישום של נייר הערך בבורסה ונייר הערך עומד בכל תנאי הסף של המדד במועד הקובע כאמור. בעת צירוף נייר ערך למדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב מדד, לא יגרע מהמדד נייר ערך אחר עד למועד עדכון הרכב המדד הבא.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iINDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

## חישוב המדד

- תחילת פרסום: 03/11/2022.
- התחלת שערים היסטוריים: 02/08/2012.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת ברוטו (GTR).
- מטבע חישוב: שקל חדש.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: 4%.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: אין.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: תיקון פקטור מגבלת משקל של ניירות ערך במדד במקרה ומנפיק נייר הערך רשם רווח נקי שנתי שלילי בשנתיים או יותר מבין 5 השנים האחרונות שקדמו למועד הקובע: רווח נקי שנתי שלילי ב-5 מתוך 5 השנים כאמור - פקטור 0.5X; רווח נקי שנתי שלילי ב-4 מתוך 5 השנים כאמור - פקטור 0.6X; רווח נקי שנתי שלילי ב-3 מתוך 5 השנים כאמור - פקטור 0.7X; רווח נקי שנתי שלילי בשנתיים מתוך 5 השנים כאמור - פקטור 0.8X.

## שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.



**תמצית המדד**

המדד עוקב אחר 40 החברות הישראליות בעלות שווי השוק הגבוה ביותר בבורסה בישראל.

**מזהה המדד**

סימול מדד: 2124.

**הרכב ניירות הערך במדד**

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה, יחידות השתתפות בשותפות מוגבלת או יחידות השתתפות בקרן ריט (REIT).
- ניירות הערך רשומים למסחר בבורסה בישראל.
- ניירות הערך נקובים בש"ח.
- מנפיקי ניירות הערך הם בעלי זיקה לישראל בהתאם לעקרונות המפורטים בסיווג iNDEX-Geo.
- שווי שוק החזקות הציבור של ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-75 מיליון ש"ח.
- שיעור החזקות הציבור של ניירות הערך במועד הקובע אינו פוחת מ-20%.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-250,000 ש"ח.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\*.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.
- \* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 40.

**עדכונים במדד**

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: חצי שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: נייר ערך שנרשם למסחר אחרי המועד הקובע לעדכון הרכב המדד, עשוי להתווסף למדד בעדכון משקלות רבעוני במידה ושווי השוק הממוצע של נייר הערך במועד הקובע לעדכון המשקלות הרבעוני שווה או גבוה משווי השוק של נייר ערך בעל דירוג שווי שוק ממוצע במקום ה-25 במדד במועד הקובע כאמור, ובלבד שבמועד הקובע כאמור חלפו 60 ימים ממועד הרישום של נייר הערך בבורסה ונייר הערך עומד בכל תנאי הסף של המדד במועד הקובע כאמור. בעת צירוף נייר ערך למדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב מדד, לא יגרע מהמדד נייר ערך אחר עד למועד עדכון הרכב המדד הבא.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iNDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

## חישוב המדד

- תחילת פרסום: 03/11/2022.
- התחלת שערים היסטוריים: 02/08/2012.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת ברוטו (GTR).
- מטבע חישוב: שקל חדש.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: 6%.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: אין.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: תיקון פקטור מגבלת משקל של ניירות ערך במדד במקרה ומנפיק נייר הערך רשם רווח נקי שנתי שלילי בשנתיים או יותר מבין 5 השנים האחרונות שקדמו למועד הקובע: רווח נקי שנתי שלילי ב-5 מתוך 5 השנים כאמור - פקטור 0.5X; רווח נקי שנתי שלילי ב-4 מתוך 5 השנים כאמור - פקטור 0.6X; רווח נקי שנתי שלילי ב-3 מתוך 5 השנים כאמור - פקטור 0.7X; רווח נקי שנתי שלילי בשנתיים מתוך 5 השנים כאמור - פקטור 0.8X.

## שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

### תמצית המדד

המדד עוקב אחר 80 החברות הישראליות בעלות שווי השוק הגבוה ביותר בבורסה בישראל מבין המניות שאינן נכללות במדד אינדקס 40 ישראל.

### מזהה המדד

סימול מדד: 2125.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה, יחידות השתתפות בשותפות מוגבלת או יחידות השתתפות בקרן ריט (REIT).
- ניירות הערך רשומים למסחר בבורסה בישראל.
- ניירות הערך נקובים בש"ח.
- מנפיקי ניירות הערך הם בעלי זיקה לישראל בהתאם לעקרונות המפורטים בסיווג iNDEX-Geo.
- שווי שוק החזקות הציבור של ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-75 מיליון ש"ח.
- שיעור החזקות הציבור של ניירות הערך במועד הקובע אינו פוחת מ-20%.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-50,000 ש"ח.
- ניירות הערך אינם נכללים במדד אינדקס 40 ישראל.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\*.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.

\* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 80.

### עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: חצי שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: נייר ערך שנרשם למסחר אחרי המועד הקובע לעדכון הרכב המדד, עשוי להתווסף למדד בעדכון משקלות רבעוני במידה ושווי השוק הממוצע של נייר הערך במועד הקובע לעדכון המשקולות הרבעוני שווה או גבוה משווי השוק של נייר ערך בעל דירוג שווי שוק ממוצע במקום ה-60 במדד במועד הקובע כאמור, ובלבד שבמועד הקובע כאמור חלפו 60 ימים ממועד הרישום של נייר הערך בבורסה ונייר הערך עומד בכל תנאי הסף של המדד במועד הקובע כאמור. בעת צירוף נייר ערך למדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב מדד, לא יגרע מהמדד נייר ערך אחר עד למועד עדכון הרכב המדד הבא.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.

- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iINDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

### **חישוב המדד**

- תחילת פרסום: 03/11/2022.
- התחלת שערים היסטוריים: 02/08/2012.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת ברוטו (GTR).
- מטבע חישוב: שקל חדש.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: 4%.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: אין.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: תיקון פקטור מגבלת משקל של ניירות ערך במדד במקרה ומנפיק נייר הערך רשם רווח נקי שנתי שלילי בשנתיים או יותר מבין 5 השנים האחרונות שקדמו למועד הקובע: רווח נקי שנתי שלילי ב-5 מתוך 5 השנים כאמור - פקטור 0.5X; רווח נקי שנתי שלילי ב-4 מתוך 5 השנים כאמור - פקטור 0.6X; רווח נקי שנתי שלילי ב-3 מתוך 5 השנים כאמור - פקטור 0.7X; רווח נקי שנתי שלילי בשנתיים מתוך 5 השנים כאמור - פקטור 0.8X.

### **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

### תמצית המדד

המדד עוקב אחר 100 החברות בעלות שווי השוק הגבוה ביותר בישראל עם רוחחיות עקבית לאורך זמן, הנסחרות בבורסה בישראל, תוך מתן משקל אחיד לכל המניות הנכללות במדד.

### מזהה המדד

סימול מדד: 2102.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה, יחידות השתתפות בשותפות מוגבלת או יחידות השתתפות בקרן ריט (REIT).
- ניירות הערך רשומים למסחר בבורסה בישראל.
- ניירות הערך נקובים בש"ח.
- מנפיקי ניירות הערך הם בעלי זיקה לישראל בהתאם לעקרונות המפורטים בסיווג iNDEX-Geo.
- מנפיקי ניירות הערך רשמו רווח נקי שנתי חיובי במהלך שנתיים מתוך 3 השנים שקדמו למועד הקובע לעדכון הרכב המדד או לחילופין, ב-3 מתוך 5 השנים שקדמו למועד הקובע לעדכון הרכב המדד.
- שיעור החזקות הציבור של ניירות הערך במועד הקובע אינו פוחת מ-20%.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-50,000 ש"ח.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\*.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.

\* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 100.

### עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: נייר ערך שנרשם למסחר אחרי המועד הקובע לעדכון הרכב המדד, עשוי להתווסף למדד בעדכון משקלות רבעוני במידה ושווי השוק הממוצע של נייר הערך במועד הקובע לעדכון המשקלות הרבעוני שווה או גבוה משווי השוק של נייר ערך בעל דירוג שווי שוק ממוצע במקום ה-75 במדד במועד הקובע כאמור, ובלבד שבמועד הקובע כאמור חלפו 60 ימים ממועד הרישום של נייר הערך בבורסה ונייר הערך עומד בכל תנאי הסף של המדד במועד הקובע כאמור. בעת צירוף נייר ערך למדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב מדד, לא יגרע מהמדד נייר ערך אחר עד למועד עדכון הרכב המדד הבא.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.

- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iINDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

### **חישוב המדד**

- תחילת פרסום: 01/06/2017.
- התחלת שערים היסטוריים: 02/08/2012.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת ברוטו (GTR).
- מטבע חישוב: שקל חדש.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד משקל אחיד.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: 1.5%.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.25%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: אין.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: אין.

### **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

**תמצית המדד**

המדד עוקב אחר חברות בעלות רווחיות עקבית לאורך זמן ושווי שוק בינוני בבורסה בת"א (750 מיליון עד 5 מיליארד ₪ במועד הקובע לעדכון המדד).

**מזהה המדד**

סימול מדד: 2106.

**הרכב ניירות הערך במדד**

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה, יחידות השתתפות בשותפות מוגבלת או יחידות השתתפות בקרן ריט (REIT).
- ניירות הערך רשומים למסחר בבורסה בישראל.
- ניירות הערך נקובים בש"ח.
- מנפיקי ניירות הערך הם בעלי זיקה לישראל בהתאם לעקרונות המפורטים בסיווג iNDEX-Geo.
- מנפיקי ניירות הערך רשמו רווח נקי שנתי חיובי במהלך שנתיים מתוך 3 השנים שקדמו למועד הקובע לעדכון הרכב המדד או לחילופין, ב-3 מתוך 5 השנים שקדמו למועד הקובע לעדכון הרכב המדד.
- שווי שוק של ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-750 מיליון ש"ח ואינו עולה על 5 מיליארד ש"ח.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-10,000 ש"ח.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-50.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.
- \* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 150.

**עדכונים במדד**

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: נייר ערך שנרשם למסחר אחרי המועד הקובע לעדכון הרכב המדד, עשוי להתווסף למדד בעדכון משקלות רבעוני במידה ושווי השוק הממוצע של נייר הערך במועד הקובע לעדכון המשקלות הרבעוני אינו נמוך ממיליארד ש"ח ואינו עולה על 4.5 מיליארד ש"ח במועד הקובע כאמור, ובלבד שבמועד הקובע כאמור חלפו 60 ימים ממועד הרישום של נייר הערך בבורסה ונייר הערך עומד בכל תנאי הסף של המדד במועד הקובע כאמור. בעת צירוף נייר ערך למדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב מדד, לא יגרע מהמדד נייר ערך אחר עד למועד עדכון הרכב המדד הבא.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.

- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iINDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

### **חישוב המדד**

- תחילת פרסום: 01/06/2017.
- התחלת שערים היסטוריים: 02/08/2012.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת ברוטו (GTR).
- מטבע חישוב: שקל חדש.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: בהתאם למפורט בפרק "תקרות משקל במדדי שווי שוק" להלן.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: אין.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: אין.

### **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.



### תמצית המדד

המדד עוקב אחר חברות בעלות רווחיות עקבית לאורך זמן ושווי שוק נמוך-בינוני בבורסה בת"א (עד 1.5 מיליארד ₪ במועד הקובע לעדכון המדד).

### מזהה המדד

סימול מדד: 2107.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה, יחידות השתתפות בשותפות מוגבלת או יחידות השתתפות בקרן ריט (REIT).
- ניירות הערך רשומים למסחר בבורסה בישראל.
- ניירות הערך נקובים בש"ח.
- מנפיקי ניירות הערך הם בעלי זיקה לישראל בהתאם לעקרונות המפורטים בסיווג iNDEX-Geo.
- מנפיקי ניירות הערך רשמו רווח נקי שנתי חיובי במהלך שנתיים מתוך 3 השנים שקדמו למועד הקובע לעדכון הרכב המדד או לחילופין, ב-3 מתוך 5 השנים שקדמו למועד הקובע לעדכון הרכב המדד.
- שווי שוק של ניירות הערך במועד הקובע אינו עולה על 1.5 מיליארד ש"ח.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-5,000 ש"ח.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-80.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.
- \* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 200.

### עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: נייר ערך שנרשם למסחר אחרי המועד הקובע לעדכון הרכב המדד, עשוי להתווסף למדד בעדכון משקלות רבעוני במידה ושווי השוק הממוצע של נייר הערך במועד הקובע לעדכון המשקלות הרבעוני אינו עולה על מיליארד ש"ח במועד הקובע כאמור, ובלבד שבמועד הקובע כאמור חלפו 60 ימים ממועד הרישום של נייר הערך בבורסה ונייר הערך עומד בכל תנאי הסף של המדד במועד הקובע כאמור. בעת צירוף נייר ערך למדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב מדד, לא יגרע מהמדד נייר ערך אחר עד למועד עדכון הרכב המדד הבא.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.

- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iINDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

### **חישוב המדד**

- תחילת פרסום: 01/06/2017.
- התחלת שערים היסטוריים: 02/08/2012.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת ברוטו (GTR).
- מטבע חישוב: שקל חדש.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: בהתאם למפורט בפרק "תקרות משקל במדדי שווי שוק" להלן.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: אין.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: אין.

### **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

### תמצית המדד

המדד כולל מניות הנסחרות בישראל, בעלות דירוג הערך הגבוה ביותר מבין כל המניות הנכללות במדד אינדקס-120 ישראל, כאשר דירוג זה מתבסס על מכפילי ההון (P/B), הרווח (P/E) ויחס שווי פעילות לרווח לפני הוצאות ריבית מס פחת והפחתות (EV/EBITDA).

"**דירוג ערך משוקלל**" מחושב באמצעות סכימת הערכים המנורמלים של 3 היחסים הבאים בכל נייר ערך הנכלל במדד אינדקס 120 ישראל במועד הקובע להרכב המדד: מכפיל הון (P/B), מכפיל רווח (P/E) ויחס שווי פעילות לרווח לפני הוצאות ריבית מס פחת והפחתות (EV/EBITDA). תחילה מתבצע נרמול בין 0 ל-1 של קבוצת ניירות הערך שערכיה נמוכים מהחציון (עבור כל יחס פיננסי כאמור בנפרד) כאשר במידה ואין מידע זמין על נייר ערך מסוים ו/או שהיחס הפיננסי של נייר ערך מסוים עולה על החציון - החציון שיקבל נייר הערך ביחס כאמור הוא 1. עבור ניירות ערך של בנקים החציון בגין היחס של EV/EBITDA מקובע על 0.5.

נייר הערך בעל החציון הנמוך ביותר (דירוג ערך משוקלל הטוב ביותר) ידורג בדירוג "1" ויחשב לנייר הערך בדירוג הגבוה ביותר. נייר הערך בעל החציון השני ידורג בדירוג "2" ויחשב לנייר הערך בדירוג השני הגבוה ביותר, וכן הלאה. ניירות ערך בעל יחס זהה ידורגו בדירוג זהה.

### מזהה המדד

סימול מדד: 2149.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה, יחידות השתתפות בשותפות מוגבלת או יחידות השתתפות בקרן ריט (REIT).
- ניירות הערך רשומים למסחר בבורסה בישראל.
- ניירות הערך נקובים בש"ח.
- ניירות הערך הנכללים במדד יכללו במקביל במדד אינדקס 120-ישראל.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-30.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג ערך משוקלל של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25 ניירות ערך בעלי דירוג ערך משוקלל הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך שדירוג הערך המשוקלל שלהם לא יפחת מדירוג הערך המשוקלל של נייר הערך בעל דירוג הערך המשוקלל הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע.
- \* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 50.

### עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iNDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

## **חישוב המדד**

- תחילת פרסום: 20/06/2021.
- התחלת שערים היסטוריים: 03/08/2017.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת ברוטו (GTR).
- מטבע חישוב: שקל חדש.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד משקל אחיד.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: 5%.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: אין.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: תיקון פקטור מגבלת משקל של ניירות ערך במדד בהתאם לדירוג ערך משוקלל - פקטור יחסי שבין 0.75 עד 1.25.

## **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

### תמצית המדד

המדד כולל מניות של חברות ישראליות הנסחרות בבורסה בישראל כאשר כל אחד מבין הסקטורים המרכזיים מיוצג על ידי 5 המניות בדירוג הערך (Value) הגבוה ביותר מבין כל המניות מאותו סקטור שעמדו בתנאי הסף. "דירוג ערך סקטוריאלי" מחושב באמצעות סכימת הערכים המנורמלים של 3 היחסים הבאים בכל נייר ערך העומד בתנאי הסף של המדד במועד הקובע להרכב המדד ביחס לסקטור שלו: מכפילי ההון (P/B), מכפיל מכירות (P/S) ומכפיל תזרים מזומנים. תחילה מתבצעת חלוקה של ניירות הערך לסקטורים בהתאם לסיווג GICS (אנרגיה, בריאות, חומרי גלם, טכנולוגיה, צריכה בסיסית, צריכה מחזורית, נדל"ן, פיננסים, תעשייה, תקשורת ותשתיות). לאחר מכן, מבוצע דירוג ניירות הערך בכל סקטור על פי 3 היחסים כאמור, כאשר הדירוג מבוצע על פי שיקלול הציונים המנורמלים המתקבלים לכל מניה מכל אחד מהיחסים (בכל יחס יש ציון בין 0 ל-1 שכל מניה מקבלת בהתאם לשאר המניות בסקטור שלה והמשקל של כל יחס הינו שליש בשיקלול הדירוג). כל המניות שאינן מדורגות במועד הקובע בדירוג 5 המניות בעלות היחס האיכותי ביותר בשקלול הפרמטרים מבין כל המניות בסקטור שלהן לא תיכללנה במדד. בתום השלב האחרון צפויים להתקבל עד 55 מניות המייצגות את 5 המניות בדירוג הערך (Value) הגבוה ביותר מבין כל המניות מאותו סקטור עבור 11 הסקטורים המרכזיים.

### מזהה המדד

סימול מדד: 2130.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד זאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה, יחידות השתתפות בשותפות מוגבלת או יחידות השתתפות בקרן ריט (REIT).
- ניירות הערך רשומים למסחר בבורסה בישראל.
- ניירות הערך נקובים בש"ח.
- מנפיקי ניירות הערך הם בעלי זיקה לישראל בהתאם לעקרונות המפורטים בסיווג iINDEX-Geo.
- שווי שוק החזקות הציבור של ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-75 מיליון ש"ח.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-10,000 ש"ח.
- מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 55.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג ערך סקטוריאלי של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד ויכללו במדד עד 5 המניות בדירוג הערך (Value) הגבוה ביותר מבין כל המניות מאותו סקטור. במסגרת זאת ידורגו כל המניות בכל סקטור על פי היחסים הבאים: מכפיל הון, מכפיל מכירות ומכפיל תזרים מזומנים, כאשר הדירוג מבוצע על פי שיקלול הציונים המנורמלים המתקבלים לכל מניה מכל אחד מהיחסים (בכל יחס יש ציון בין 0 ל-1 שכל מניה מקבלת בהתאם לשאר המניות בסקטור שלה והמשקל של כל יחס הינו שליש בשיקלול הדירוג) ויגרעו מהמדד כל המניות שאינן מדורגות במועד הקובע בדירוג 5 המניות בעלות היחס האיכותי ביותר בשקלול הפרמטרים מבין כל המניות בסקטור שלהן. באופן זה, יתקבלו עד 55 מניות המייצגות את 5 המניות בדירוג הערך (Value) הגבוה ביותר מבין כל המניות מאותו סקטור עבור הסקטורים המרכזיים על פי סיווג GICS.

### עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.

- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iINDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

#### **חישוב המדד**

- תחילת פרסום: 08/12/2021.
- התחלת שערים היסטוריים: 03/08/2017.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת ברוטו (GTR).
- מטבע חישוב: שקל חדש.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד משקל אחיד.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: 5%.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: אין.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: אין.

#### **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

### תמצית המדד

המדד כולל מניות של חברות ישראליות הנסחרות בבורסה בישראל, בעלות תשואת דיבידנד של 3% ומעלה ואשר חילקו דיבידנד בשנה שקדמה למועד הקובע ובשנתיים מתוך 3 השנים האחרונות.

### מזהה המדד

סימול מדד: 2131.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה, יחידות השתתפות בשותפות מוגבלת או יחידות השתתפות בקרן ריט (REIT).
- ניירות הערך רשומים למסחר בבורסה בישראל.
- ניירות הערך נקובים בש"ח.
- מנפיקי ניירות הערך משייכים לישראל בהתאם לסיווג iINDEX-Geo.
- מנפיקי ניירות הערך רשמו רווח נקי שנתי חיובי במהלך שנתיים מתוך 3 השנים שקדמו למועד הקובע לעדכון הרכב המדד או לחילופין, ב-3 מתוך 5 השנים שקדמו למועד הקובע לעדכון הרכב המדד.
- ניירות ערך של חברות שלא חילקו דיבידנד בשנה שקדמה למועד הקובע ובשנתיים מתוך 3 השנים האחרונות לא יכללו במדד.
- ניירות ערך שתשואת הדיבידנד שלהם במועד הקובע תפחת מ-3% לא יכללו במדד.
- שווי שוק ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-750 מיליון ש"ח.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-10,000 ש"ח.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-20.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.
- \* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 60.

### עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iINDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

### חישוב המדד

- תחילת פרסום: 12/02/2023.

- התחלת שיערים היסטוריים: 01/08/2019.
  - ערך בסיס: 1,000.
  - אופן החישוב: מדד תשואה כוללת ברוטו (GTR).
  - מטבע חישוב: שקל חדש.
  - מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
  - תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: 5%.
  - משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
  - תקרת משקל ענפית במועד הקובע: אין.
  - פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: אין.
- שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**
- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
  - האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.



### **תמצית המדד**

המדד כולל מניות ישראליות הנסחרות בבורסה בישראל, בעלות דירוג הצמיחה הגבוה ביותר מבין כל המניות העומדות בתנאי הסף של המדד.

"**דירוג צמיחה משוקלל**" מתבסס על חישוב הצמיחה השנתית הממוצעת בהכנסות ב-5 השנים שקדמו למועד הקובע לעדכון הרכב המדד של כל המניות העומדות בתנאי הסף של המדד, כאשר היה והצמיחה השנתית האחרונה של חברה מסוימת לא עלתה על הצמיחה החציונית השנתית האחרונה של כל המניות העומדות בתנאי הסף של המדד, מנייתה לא תיכלל במדד במועד העדכון הקרוב ולא תקבל דירוג צמיחה משוקלל.

נייר הערך בעל שיעור הצמיחה הגבוה ביותר ידורג בדירוג "1" ויחשב לנייר הערך בדירוג הגבוה ביותר. נייר הערך בעל שיעור הצמיחה השני ידורג בדירוג "2" ויחשב לנייר הערך בדירוג השני הגבוה ביותר, וכן הלאה. ניירות ערך בעל יחס זהה ידורגו בדירוג זהה.

### **מזהה המדד**

סימול מדד: 2147.

### **הרכב ניירות הערך במדד**

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה, יחידות השתתפות בשותפות מוגבלת או יחידות השתתפות בקרן ריט (REIT).
- ניירות הערך רשומים למסחר בבורסה בישראל.
- ניירות הערך נקובים בש"ח.
- מנפיקי ניירות הערך משויכים לישראל בהתאם לסיווג iNDEX-Geo.
- מנפיקי ניירות הערך רשמו הכנסה שנתית צומחת ביחס לשנה הקודמת במהלך שנתיים מתוך 3 השנים שקדמו למועד הקובע לעדכון הרכב המדד או לחילופין, ב-3 מתוך 5 השנים שקדמו למועד הקובע לעדכון הרכב המדד.
- שווי שוק החזקות הציבור של ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-75 מיליון ש"ח.
- שיעור החזקות הציבור של ניירות הערך במועד הקובע אינו פוחת מ-20%.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-10,000 ש"ח.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-30.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג צמיחה משוקלל של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 30 ניירות ערך בעלי דירוג צמיחה משוקלל הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך שדירוג הצמיחה המשוקלל שלהם לא יפחת מדירוג הצמיחה המשוקלל של נייר הערך בעל דירוג הצמיחה המשוקלל הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע.

\* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 60.

### **עדכונים במדד**

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.

- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iINDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

### **חישוב המדד**

- תחילת פרסום: 06/08/2017.
- התחלת שיעור היסטוריים: 09/05/2022.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת ברוטו (GTR).
- מטבע חישוב: שקל חדש.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: 3%.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: אין.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: (1) תיקנון פקטור מגבלת משקל של ניירות ערך במדד בהתאם לשיעור הצמיחה בהכנסה השנתית בשנה שקדמה למועד הקובע, לשיעור הצמיחה ברווח הנקי השנתי בשנה שקדמה למועד הקובע ולשיעור הצמיחה בתזרים המזומנים השנתי בשנה שקדמה למועד הקובע. הציונים המתקבלים לכל נייר ערך ינורמלו בין 0.75 ל-1.5 והפקטור יוכפל בציון המנורמל שהתקבל - קרי, יעלה עד 50% או לחילופין, יופחת עד 25%. (2) תיקנון פקטור מגבלת משקל של ניירות ערך במדד במקרה ומנפיק נייר הערך רשם רווח נקי שנתי שלילי בשנה שקדמה למועד הקובע לעדכון הרכב המדד - פקטור 0.75X.

### **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

### תמצית המדד

המדד כולל מניות של חברות בעלות רווחיות עקבית ותזרים מזומנים צומח לאורך זמן, אשר התשואה שלהן על ההון העצמי הינה הגבוהה מבין המניות הנכללות במדד ת"א-125, כאשר משקל המניות במדד מוטה לטובת מניות במינוף פיננסי נמוך.

"דירוג תשואה על ההון העצמי" מחושב לפי תשואה על ההון העצמי של ניירות הערך העומדים בתנאי הסף של המדד. נייר הערך בעל היחס הגבוה ביותר ידורג בדירוג "1" ויחשב לנייר הערך המדורג בדירוג הגבוה ביותר. נייר הערך בעל היחס השני הגבוה ביותר ידורג בדירוג "2" ויחשב לנייר הערך המדורג בדירוג השני הגבוה ביותר, וכן הלאה. ניירות ערך בעלי יחס זהה ידורגו בדירוג זהה.

### מזהה המדד

סימול מדד: 2128.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה, יחידות השתתפות בשותפות מוגבלת או יחידות השתתפות בקרן ריט (REIT).
  - ניירות הערך רשומים למסחר בבורסה בישראל.
  - ניירות הערך נקובים בש"ח.
  - ניירות הערך הנכללים במדד יכללו במקביל במדד ת"א-125.
  - מנפיקי ניירות הערך רשמו רווח נקי שנתי חיובי במהלך שנתיים מתוך 3 השנים שקדמו למועד הקובע לעדכון הרכב המדד או לחילופין, ב-3 מתוך 5 השנים שקדמו למועד הקובע לעדכון הרכב המדד.
  - מנפיקי ניירות הערך לא רשמו תזרים מזומנים שלילי בשנה שקדמה למועד הקובע לעדכון הרכב המדד.
  - מנפיקי ניירות הערך רשמו רווח בעלי תזרים מזומנים חיובי במהלך שנתיים מתוך 3 השנים שקדמו למועד הקובע לעדכון הרכב המדד או לחילופין, ב-3 מתוך 5 השנים שקדמו למועד הקובע לעדכון הרכב המדד.
  - ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-30.
  - סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג תשואה על ההון העצמי של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 20 ניירות ערך בעלי דירוג תשואה על ההון העצמי הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך בעלי דירוג תשואה על ההון העצמי שלא יפחת מדירוג תשואה על ההון העצמי של נייר הערך בעל דירוג תשואה על ההון העצמי הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע.
- \* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 50.

### עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: חצי שנתי, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.

- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iINDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

### **חישוב המדד**

- תחילת פרסום: 21/11/2019.
- התחלת שערים היסטוריים: 30/06/2014.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת ברוטו (GTR).
- מטבע חישוב: שקל חדש.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: 3%.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: אין.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: תיקון פקטור מגבלת משקל של ניירות ערך במדד בהתאם למיקום דירוג הון עצמי למאזן של נייר הערך ביחס להון עצמי למאזן של כל ניירות הערך במדד: נייר ערך שדורג בחציון העליון - פקטור 1.25X; נייר ערך שדורג בחציון התחתון - פקטור 0.75X.

### **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

**תמצית המדד**

המדד עוקב אחר מניות הנכללות במדד ת"א-125, כאשר משקל המניות במדד מתוקנן לפי היחס שבין הממוצע הנע של המניה ב-50 ימי המסחר האחרונים לבין הממוצע הנע של המניה ב-200 ימי המסחר האחרונים. "דירוג Smart Momentum" מחושב לפי היחס שבין המחיר הממוצע של נייר הערך ב-50 ימי המסחר האחרונים לבין המחיר מממוצע של נייר הערך ב-200 ימי המסחר האחרונים, של ניירות הערך העומדים בתנאי הסף של המדד. נייר הערך בעל היחס הגבוה ביותר ידורג בדירוג "1" ויחשב לנייר הערך המדורג בדירוג הגבוה ביותר. נייר הערך בעל היחס השני הגבוה ביותר ידורג בדירוג "2" ויחשב לנייר הערך המדורג בדירוג השני הגבוה ביותר, וכן הלאה. ניירות ערך בעלי יחס זהה ידורגו בדירוג זהה.

המדד מבוסס על המשקל המקורי של כל נייר ערך במדד ת"א-125, אשר מתוקנן בהתאם לסטטוס המומנטום הנוכחי שנייר הערך משויך במדד. נייר ערך שבמועד הקובע דורג בשליש העליון בדירוג המומנטום של כל ניירות הערך במדד, יקבל משקל עודף במדד ומנגד נייר ערך שבמועד הקובע דורג בשליש התחתון בדירוג המומנטום של כל ניירות הערך במדד, יקבלו משקל חסר במדד.

ניירות ערך שבמועד הקובע נכללו בשליש העליון במדד והתמורה הכספית הממוצעת שלהם ב-90 הימים שקדמו למועד הקובע עלו על התכ"מ ב-90 ימי המסחר שקדמו ל-90 ימי המסחר האחרונים, יקבלו תוספת משקל נוספת.

**מזהה המדד**

סימול מדד: 2134.

**הרכב ניירות הערך במדד**

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה, יחידות השתתפות בשותפות מוגבלת או יחידות השתתפות בקרן ריט (REIT).
- ניירות הערך רשומים למסחר בבורסה בישראל.
- ניירות הערך נקובים בש"ח.
- ניירות הערך הנכללים במדד יכללו במקביל במדד ת"א-125.

**עדכונים במדד**

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: חצי-שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "INDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

**חישוב המדד**

- תחילת פרסום: 04/07/2021.
- התחלת שערים היסטוריים: 03/08/2017.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת ברוטו (GTR).

- מטבע חישוב: שקל חדש.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: 10%.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: אין.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: (1) תיקנון פקטור מגבלת משקל של ניירות ערך במדד בהתאם למיקום דירוג Smart Momentum: נייר ערך שדורג בשליש העליון - פקטור 1.5X; נייר ערך שדורג בשליש התחתון - פקטור 0.5X. (2) תיקנון פקטור מגבלת משקל של נייר ערך שדורג בשליש העליון במדד בדירוג Smart Momentum והתכ"מ 90 יום שלו עלה על התכ"מ 90 יום בתקופה הקודמת (קרי, ב-90 ימי המסחר שקדמו ל-90 ימי המסחר האחרונים) - פקטור 1.25X.

#### **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

### **תמצית המדד**

המדד כולל מניות הנכללות במדד ת"א-125, כאשר משקל המניות במדד מוטה לטובת חברות המסווגות בענפי הבורסה בעלי מומנטום תשואה חיובי (ביצועי מניות הענף בתקופה שקדמה לעדכון המדד גבוה ביחס ליתר הענפים במדד).

"**דירוג מומנטום ענפי**" מחושב לפי סכימת ציוני המומנטום של כל ניירות הערך הנכללים בענף בורסה מסוים, כאשר ציון מומנטום של נייר ערך במדד מחושב על בסיס שער נייר הערך במועד הקובע ביחס לשער נייר הערך הממוצע ב-8 החודשים שקדמו למועד הקובע (50% מהציון) וליחס שבין שער נייר הערך הממוצע ב-50 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לבין שער נייר הערך הממוצע ב-200 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע (50% מהציון). הענף בעל היחס הגבוה ביותר ידורג בדירוג "1" ויחשב לענף המדורג בדירוג הגבוה ביותר. הענף בעל היחס השני הגבוה ביותר ידורג בדירוג "2" ויחשב לענף המדורג בדירוג השני הגבוה ביותר, וכן הלאה. ענפים בעלי יחס זהה ידורגו בדירוג זהה.

המדד מבוסס על המשקל המקורי של כל נייר ערך במדד ת"א-125, אשר מתוקנן בהתאם לסטטוס המומנטום הנוכחי של הענף. נייר ערך המסווג בענף שנכלל בין 3 ענפי הבורסה בעלי דירוג מומנטום ענפי הגבוה ביותר, יקבל משקל עודף במדד ומנגד נייר ערך המסווג בענף שנכלל בין 3 ענפי הבורסה בעלי דירוג מומנטום ענפי הנמוך ביותר, יקבלו משקל חסר במדד.

### **מזהה המדד**

סימול מדד: 2148.

### **הרכב ניירות הערך במדד**

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה, יחידות השתתפות בשותפות מוגבלת או יחידות השתתפות בקרן ריט (REIT).
- ניירות הערך רשומים למסחר בבורסה בישראל.
- ניירות הערך נקובים בש"ח.
- ניירות הערך הנכללים במדד יכללו במקביל במדד ת"א-125.

### **עדכונים במדד**

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: חצי-שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iNDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

### **חישוב המדד**

- תחילת פרסום: 12/01/2022.
- התחלת שיערים היסטוריים: 09/02/2017.
- ערך בסיס: 1,000.

- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת ברוטו (GTR).
- מטבע חישוב: שקל חדש.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: 10%.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: אין.

▪ פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: תיקון פקטור מגבלת משקל של ניירות ערך במדד בהתאם למיקום דירוג מומנטום ענפי: נייר ערך המסווג בענף שנכלל בין 3 ענפי הבורסה בעלי דירוג מומנטום ענפי הגבוה ביותר - פקטור 2X; נייר ערך המסווג בענף שנכלל בין 3 ענפי הבורסה בעלי דירוג מומנטום משוקלל ענפי ביותר - פקטור 0.5X.

### **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.



### תמצית המדד

המדד כולל 30 מניות הנסחרות בבורסה בישראל, אשר היחס שבין המחיר הממוצע של כל מניה ב-50 ימי המסחר האחרונים לבין המחיר הממוצע של המניה ב-200 ימי המסחר האחרונים הינו הנמוך מבין המניות העומדות בתנאי הסף של המדד.

"**דירוג מומנטום שלילי**" מחושב לפי היחס שבין המחיר הממוצע של המניה ב-50 ימי המסחר האחרונים לבין המחיר הממוצע של המניה ב-200 ימי המסחר האחרונים (50% מהציון) והיחס של שער המניה במועד הקובע ביחס לשער המניה הממוצע ב-180 יום שקדמו למועד הקובע (50% מהציון), של המניות העומדות בתנאי הסף של המדד, כאשר המניה בעלת היחס הנמוך ביותר תדורג בדירוג "1" ותיחשב למניה המדורגת בדירוג הגבוה ביותר. המניה בעלת היחס השני הנמוך ביותר תדורג בדירוג "2" ותיחשב למניה המדורגת בדירוג השני הגבוה ביותר, וכן הלאה. מניות בעלות יחס זהה ידורגו בדירוג זהה.

### מזהה המדד

סימול מדד: 2132.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה, יחידות השתתפות בשותפות מוגבלת או יחידות השתתפות בקרן ריט (REIT).
- ניירות הערך רשומים למסחר בבורסה בישראל.
- ניירות הערך נקובים בש"ח.
- מנפיקי ניירות הערך הם בעלי זיקה לישראל בהתאם לעקרונות המפורטים בסיווג iNDEX-Geo.
- ניירות ערך ששווי נכסים נקי הידוע במועד הקובע של כל קרנות סל (ETF) העוקבים אחריהם לא יעלה על חצי מיליון ₪ לא יכללו במדד.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-10,000 ש"ח.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-20.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג מומנטום שלילי של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד.

\* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 30.

### עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iNDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

### חישוב המדד

▪ תחילת פרסום: 23/03/2022.

▪ התחלת שיערים היסטוריים: 01/02/2018.

- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת ברוטו (GTR).
- מטבע חישוב: שקל חדש.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד משקל מומנטום.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: 7%.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: אין.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: (1) תיקנון פקטור מגבלת משקל של ניירות ערך במדד בהתאם לדירוג מומנטום שלילי - פקטור יחסי שבין 0.75 עד 1.5; (2) תיקנון פקטור מגבלת משקל של ניירות ערך במדד שמנפיקם רשם תזרים מזומנים שלילי מפעילות שוטפת בשנה שקדמה למועד הקובע - פקטור 1.2X; (3) תיקנון פקטור מגבלת משקל של ניירות ערך במדד שמכפיל המכירות שלהם ביחס ליתר ניירות הערך במדד הינו בעשירון העליון או התחתון - פקטור 1.2X; (4) תיקנון פקטור מגבלת משקל של ניירות ערך במדד שיחס החוב למאזן של מנפיקם ביחס ליתר מנפיקי ניירות הערך במדד הינו בעשירון העליון או התחתון - פקטור 1.2X; (5) תיקנון פקטור מגבלת משקל של ניירות ערך במדד בהתאם לשיעור הירידה בתזרים המזומנים מפעילות שוטפת בין השנה שקדמה למועד הקובע לבין השנה לפנייה באופן שבו ינורמלו שיעורי הירידה בתזרים של כל חברה בין 0.75 ל-1.25, קרי, במקרה של מניה ששיעור הירידה בתזרים שלה היה החד ביותר, משקלה יעלה עד 25% ביחס למגבלת המשקל האחרונה שחושבה לה; (6) תיקנון פקטור מגבלת משקל של ניירות ערך במדד ששווי נכסים נקי הידוע במועד הקובע של כל קרנות סל (ETF) העוקבים אחריהם לא יעלה על 2 מיליון ש"ח - פקטור יחסי שבין 0.25 עד 1.

#### **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

**תמצית המדד**

המדד כולל את 100 החברות בעלות דירוג ה-ESG (אחריות תאגידית) הגבוה ביותר על פי חברת המחקר אנטרופי מבין המניות הנכללות במדד ת"א-125, כאשר משקל המניות במדד מוטה לטובת מניות בעלות דירוג ESG גבוה. מודל **דירוג ESG (אחריות תאגידית) של אנטרופי** מעריך את רמת סיכון האחריות התאגידית של מנפיקי ניירות ערך בבורסה בישראל על בסיס מערכת של פרמטרים, כמותיים ואיכותיים הקשורים לעקרונות ולכללים מעולם האחריות התאגידית. הערכת מנפיק מתבססת על בחינה ואיסוף של מידע ציבורי הנוגע להיבטי ESG ובחינת השקיפות של המנפיק ושל הפרמטרים השונים וכן על בסיס שיקול דעת מקצועי. המודל מבוסס על ארבע קטגוריות:

- (1) **אחריות תאגידית כללית** - הדירוג מבוסס על קיום אסטרטגיית אחריות תאגידית או תוכנית יעדים מוצהרת בתחום האחריות התאגידית בחברה ונבחנים פרמטרים כדוגמת קודים אתיים ונהלים המציגים את הערכים, החזון וההתנהלות של החברה.
- (2) **אחריות סביבתית** - הדירוג מבוסס על סוגיות איכות הסביבה כגון: אופן הניהול של הסיכונים הסביבתיים של החברה, יעדי צמצום פליטת פחמן, מעקב ודיווח על טביעת כף רגל פחמנית ועוד.
- (3) **אחריות חברתית** - הדירוג מבוסס על על היבטים חברתיים כדוגמת מדיניות החברה בנושא גיוון כח האדם, קיום הדרכות בנושא, פרסום נתוני שיעור תחלופת העובדים וכו'.
- (4) **ממשל תאגידי** - הדירוג מבוסס על סוגיות ממשל תאגידי כגון: קיום מדיניות בתחום הציות ומניעת שוחד ושחיתות, איכות תהליכי ביקורת בחברה ביחס לכלל החברות, התמודדות עם סיכוני סייבר וכו'. הדירוג מתחשב בכ-200 פרמטרים שונים הנאספים לגבי כל חברה. איסוף המידע והערכה לגבי כלל החברות מתבצעים מדי שנה (בסמוך לפרסום הדוחות השנתיים). בנוסף, במהלך השנה מנוטרים בשוטף גם אירועים מהותיים הנוגעים לחברות הציבוריות. במסגרת הליך הדירוג, כל מנפיק מסווג על פי הקבוצות הבאות:

קבוצת סיווג ESG אנטרופי	סוגי התאגידים הנכללים בקבוצת הסיווג
<b>Leader</b>	התאגיד מוערך <u>כמוביל בתחום ומשכך הינו בעל חשיפה נמוכה לסיכון בניהול היבטי ESG</u>
<b>Improver</b>	התאגיד מוערך <u>כמי שממשיך להשתפר בתחום ומשכך הינו בעל חשיפה נמוכה לסיכון בניהול היבטי ESG</u>
<b>Moderate</b>	התאגיד מוערך <u>כמשתפר בתחום ומשכך הינו בעל חשיפה בינונית נמוכה לסיכון בניהול היבטי ESG</u>
<b>Beginner</b>	תאגיד מוערך <u>כמי שמתחיל להשתפר בתחום ומשכך הינו בעל חשיפה בינונית לסיכון בניהול היבטי ESG</u>
<b>Basic</b>	התאגיד מוערך <u>ברמה בסיסית באימוץ התחום ומשכך הינו בעל חשיפה גבוהה לסיכון בניהול היבטי ESG</u>

למידע מפורט על מודל הערכת אחריות תאגידית באנטרופי: [www.entropy.co.il/corporate-responsibility](http://www.entropy.co.il/corporate-responsibility)

אודות אנטרופי - אנטרופי ממשל תאגידי, מקבוצת אנטרופי, הוקמה בשנת 2016 ומספקת שירותי סיקור ויעוץ בנושאי ESG למשקיעים מוסדיים ולמנפיקים. במסגרת פעילותה אנטרופי ממשל תאגידי סוקרת את כלל החברות בשוק ההון הישראלי באמצעות מודל אנטרופי להערכת סיכון ממשל תאגידי למנפיקים (מודל CG) ומודל אנטרופי לאחריות תאגידית (ESG) המעריכים את סיכון התאגידים בבורסה בתל אביב בנושאי ESG וזאת כמקובל בשווקי הון מפותחים בעולם. המודלים נבנו לאחר מספר שנות מחקר ופיתוח בשיתוף עם אנשי אקדמיה ומומחים מובילים בתחום ולאחר ניתוח מקורות מידע רלוונטיים מהעולם. כחלק מפעילותה אנטרופי ממשל תאגידי מעסיקה אנליסטים ואנשי מקצוע מומחים בתחומם בעלי ניסיון רב שנים בתחומי ESG ובשוק ההון הישראלי.

למידע נוסף על אנטרופי: [www.entropy.co.il](http://www.entropy.co.il)

## מזהה המדד

סימול מדד: 2150.

## הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה, יחידות השתתפות בשותפות מוגבלת או יחידות השתתפות בקרן ריט (REIT).
- ניירות הערך רשומים למסחר בבורסה בישראל.
- ניירות הערך נקובים בש"ח.
- ניירות הערך הנכללים במדד יכללו במקביל במדד ת"א-125.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\*.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג ESG (אחריות תאגידית) של אנטרופי של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד.
- \* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 100.

## עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iNDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

## חישוב המדד

- תחילת פרסום: 08/12/2021.
- התחלת שערים היסטוריים: 06/08/2020.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת ברוטו (GTR).
- מטבע חישוב: שקל חדש.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד משקל דירוג ESG.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: 7%.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: אין.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: (1) תיקנון פקטור מגבלת משקל של ניירות ערך במדד לפי קבוצת סיווג ESG אנטרופי: Leader - פקטור 4X; Improver - פקטור 3X; Moderate - פקטור 2X; Beginner - פקטור 1.5X. (2) תיקנון פקטור מגבלת משקל של ניירות ערך של מנפיקים במדד בתחומים שנחשבים למהמים סביבתית: סיווג iNDEX-Tree באחד מהסקטורים הכלכליים הבאים: "אנרגיה" או "חומרי גלם", ובלבד שקבוצת ההתמחות של המנפיק אינה "ציוד לאנרגיה מתחדשת" - פקטור 0.5X. (3) משקל מצרפי במדד שלא יפחת מ-75% לכל ניירות הערך במדד הנכללים ב-3 הקבוצות בעלות דירוג ESG ממוצע ומעלה (קרי, קבוצות Leader, Improver ו-Moderate) - במידת הצורך יתוקן כלפי מטה פקטור מגבלת משקל של ניירות ערך של מנפיקים

אשר סוגו Beginner ו-Basic בקבוצות סיווג ESG אנטרופי עד שהמשקל המצרפי של כל ניירות הערך במדד הנכללים ב-3 הקבוצות בעלות דירוג ESG ממוצע לא יפחת מ-75%.

### **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? כן, המדד שואף לקיים כל 3 יעדי אחריות תאגידית.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? כן. תנאי הסף למדד מבוסס על דירוג ESG של כל החברות המועמדות למדד והכללת 100 בעלות דירוג ESG הגבוה ביותר. בנוסף, משקל המדד מוטה כלפי מעלה עבור ניירות ערך של מנפיקים בעלי דירוג ESG גבוה יותר.

### **תמצית המדד**

המדד כולל מניות של חברות ישראליות הנסחרות בבורסה בישראל ושיעור הייצוג הנשי בדירקטוריון שלהן אינו פוחת מ-35%.

המונח "הנהגה נשית" מתייחס להשפעה הנוצרת משילוב נשים במגוון תפקידי מפתח בארגון. מחקרים אקדמיים מעידים כי כאשר נשים מהוות למעלה מ-35% מקבוצה מסוימת, הדינמיקה הקבוצתית משתנה וההחלטות המתקבלות על-ידי הקבוצה משתנות. במצב שבו יש רק אישה אחת בעמדת ניהול בכירה, מידת השפעתה תלויה בכישורי הניהול שלה ואין הנהגה נשית בארגון. לעומת זאת, הנהגה נשית משקפת את התזה ששילוב משמעותי של נשים במגוון תפקידי מפתח בארגון משפיע על ביצועי החברה.

יובהר כי אחת לשנה יבחן עורך המדד את ההתפתחויות בשוק, ובהתאם לכך, ייתכן ויועלה הרף ליותר מ-35%. בנוסף, היה ודיווחי החברות יאפשרו, ייתכן ויוחלט בעתיד על כניסת חברות שידווחו על עמידה כנדרש ברף למדד בעדכון הרבעוני.

### **מזהה המדד**

סימול מדד: 2121.

### **הרכב ניירות הערך במדד**

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה, יחידות השתתפות בשותפות מוגבלת או יחידות השתתפות בקרן ריט (REIT).
- ניירות הערך רשומים למסחר בבורסה בישראל.
- ניירות הערך נקובים בש"ח.
- מנפיקי ניירות הערך משויכים לישראל בהתאם לסיווג iNDEX-Geo.
- שווי שוק החזקות הציבור של ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-75 מיליון ש"ח.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-10,000 ש"ח.
- שיעור הייצוג הנשי בדירקטוריון החברה בסוף שנת הכספים שקדמה למועד הקובע הינו לכל הפחות 35%.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-30.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.

\* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 60.

### **עדכונים במדד**

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.

- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iINDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

### חישוב המדד

- תחילת פרסום: 06/03/2022.
- התחלת שיעורים היסטוריים: 05/08/2017.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: GTR.
- מטבע חישוב: שקל חדש.
- מנגנון קביעת משקולות: שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: 7.5%.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: אין.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: במדד ניתן פקטור משקל בהתאם לשיעור הייצוג הנשי בדירקטוריון. קרי, ככל שהשיעור גבוה יותר, כך ניתן פקטור אשר מגדיל את משקל נייר הערך במדד ולהיפך. שיעורי הייצוג הנשי בדירקטוריון של כל מנפיק ניירות ערך במדד ינורמלו בין 0.75 ל-1.25 ופקטור מגבלת המשקל שחושב לנייר ערך של מנפיק במדד יתוקנן על פי פרמטר זה, קרי, יעלה עד 25% או לחילופין, יופחת עד 25%.

### שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? כן, המדד שואף לקיים יעד של אחריות חברתית (Social).
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? כן. בתנאי הסף של המדד קיימת דרישה כי שיעור הייצוג הנשי בדירקטוריון החברה בסוף שנת הכספים שקדמה למועד הקובע הינו לכל הפחות 35%. בנוסף, משקל המדד מוטה כלפי מעלה עבור ניירות ערך של מנפיקים שבהם שיעור הייצוג הנשי בדירקטוריון גבוה יותר.

### תמצית המדד

המדד כולל 150 מניות של חברות ישראליות הנסחרות בבורסה בישראל או בבורסות בארה"ב, מתוכם 120 המניות בעלות שווי השוק הגבוה ביותר בישראל ו-30 המניות הישראליות בעלות שווי השוק הגבוה בארה"ב.

### מזהה המדד

סימול מדד: 6905.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה, יחידות השתתפות בשותפות מוגבלת או יחידות השתתפות בקרן ריט (REIT).
- ניירות הערך רשומים למסחר בבורסה בישראל או באחת הבורסות בארה"ב. היה ונייר ערך נסחר במקביל הן בבורסה בישראל והן בבורסות מחוץ לישראל, יכלול במדד נייר ערך אשר נסחר בבורסה בישראל.
- ניירות הערך נקובים בש"ח או דולר ארה"ב.
- מנפיקי ניירות הערך משויכים לישראל בהתאם לסיווג iNDEX-Geo.
- שווי שוק החזקות הציבור של ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-75 מיליון ש"ח.
- שיעור החזקות הציבור של ניירות הערך במועד הקובע אינו פוחת מ-20%.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-50,000 ש"ח.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\*.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך הנסחרים בבורסה בישראל במדד במועד הקובע\*.
- סינון ניירות הערך הנסחרים בבורסה בישראל במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד הנסחרים בבורסה בישראל במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך הנסחרים בבורסות מחוץ לישראל במדד במועד הקובע\*.
- סינון ניירות הערך הנסחרים בבורסות מחוץ לישראל במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד הנסחרים בבורסות מחוץ לישראל במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.

\* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 150, מספר מנפיקי ניירות הערך הנסחרים בבורסה בישראל במועד הקובע לא יעלה על 120 ומספר מנפיקי ניירות הערך הנסחרים בבורסות מחוץ לישראל במועד הקובע לא יעלה על 30.

### עדכונים במדד



- תדירות ומועדי עדכון הרכב: חצי שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: נייר ערך שנרשם למסחר בבורסה בישראל אחרי המועד הקובע לעדכון הרכב המדד, עשוי להתווסף למדד בעדכון משקלות רבעוני במידה ושווי השוק הממוצע של נייר הערך במועד הקובע לעדכון המשקולות הרבעוני שווה או גבוה משווי השוק של נייר ערך בעל דירוג שווי שוק ממוצע במקום ה-100 במדד במועד הקובע כאמור, ובלבד שבמועד הקובע כאמור חלפו 60 ימים ממועד הרישום של נייר הערך בבורסה ונייר הערך עומד בכל תנאי הסף של המדד במועד הקובע כאמור. בעת צירוף נייר ערך למדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב מדד, לא יגרע מהמדד נייר ערך אחר עד למועד עדכון הרכב המדד הבא.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iNDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

### **חישוב המדד**

- תחילת פרסום: 03/11/2022.
- התחלת שערים היסטוריים: 03/08/2017.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת ברוטו (GTR).
- מטבע חישוב: שקל חדש.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: 5%.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: אין.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: משקלם המצרפי של כל ניירות הערך הנסחרים בבורסה בישראל לא יפחת מ-60% ממשקל המדד במועד הקובע.

### **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

### תמצית המדד

המדד כולל 50 מניות של חברות ישראליות הנסחרות בבורסה בישראל או בבורסות בארה"ב, מתוכם 40 המניות בעלות שווי השוק הגבוה ביותר בישראל ו-10 המניות הישראליות בעלות שווי השוק הגבוה בארה"ב.

### מזהה המדד

סימול מדד: 6906.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה, יחידות השתתפות בשותפות מוגבלת או יחידות השתתפות בקרן ריט (REIT).
- ניירות הערך רשומים למסחר בבורסה בישראל או באחת הבורסות בארה"ב. היה ונייר ערך נסחר במקביל הן בבורסה בישראל והן בבורסות מחוץ לישראל, יכלל במדד נייר ערך אשר נסחר בבורסה בישראל.
- ניירות הערך נקובים בש"ח או דולר ארה"ב.
- מנפיקי ניירות הערך משויכים לישראל בהתאם לסיווג iNDEX-Geo.
- שווי שוק החזקות הציבור של ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-75 מיליון ש"ח.
- שיעור החזקות הציבור של ניירות הערך במועד הקובע אינו פוחת מ-20%.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-50,000 ש"ח.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\*.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך הנסחרים בבורסה בישראל במדד במועד הקובע\*.
- סינון ניירות הערך הנסחרים בבורסה בישראל במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד הנסחרים בבורסה בישראל במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך הנסחרים בבורסות מחוץ לישראל במדד במועד הקובע\*.
- סינון ניירות הערך הנסחרים בבורסות מחוץ לישראל במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד הנסחרים בבורסות מחוץ לישראל במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.

\* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 50, מספר מנפיקי ניירות הערך הנסחרים בבורסה בישראל במועד הקובע לא יעלה על 40 ומספר מנפיקי ניירות הערך הנסחרים בבורסות מחוץ לישראל במועד הקובע לא יעלה על 10.

### עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: חצי שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: נייר ערך שנרשם למסחר בבורסה בישראל אחרי המועד הקובע לעדכון הרכב המדד, עשוי להתווסף למדד בעדכון משקלות רבעוני במידה ושווי השוק הממוצע של נייר הערך במועד הקובע לעדכון המשקולות הרבעוני שווה או גבוה משווי השוק של נייר ערך בעל דירוג שווי שוק ממוצע במקום ה-25 במדד במועד הקובע כאמור, ובלבד שבמועד הקובע כאמור חלפו 60 ימים ממועד הרישום של נייר הערך בבורסה ונייר הערך עומד בכל תנאי הסף של המדד במועד הקובע כאמור. בעת צירוף נייר ערך למדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב מדד, לא יגרע מהמדד נייר ערך אחר עד למועד עדכון הרכב המדד הבא.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iNDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

### **חישוב המדד**

- תחילת פרסום: 03/11/2022.
- התחלת שערים היסטוריים: 03/08/2017.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת ברוטו (GTR).
- מטבע חישוב: שקל חדש.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: 5%.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: אין.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: משקלם המצרפי של כל ניירות הערך הנסחרים בבורסה בישראל לא יפחת מ-60% ממשקל המדד במועד הקובע.

### **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

### תמצית המדד

המדד כולל מניות של חברות שנסחרות בבורסה בת"א וקרנות סל שנסחרות בארה"ב ומייצגות את שוק המניות בארה"ב, כאשר משקל כל קבוצה במדד (ישראל וח"ל בנפרד) נקבע בהתאם למנגנון מניות ישראל-ארה"ב. המדד מבוסס על מנגנון שמחלק את משקל המדד במועד הקובע בין קבוצת מניות ישראל לבין קבוצת מניות ארה"ב, כאשר מצב המוצא של המדד מתבסס על המשקל שחושב לכל קבוצה בעדכון המדד הקודם והוא עשוי להשתנות רק במידה והיה פער תשואה שלא יפחת מ-5% ב-90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לטובת הקבוצה שמשקלה נמוך יותר במדד.

בחינת פער התשואה תתבצע במועד הקובע בין ביצועי מדד ת"א-125 (המייצג את ביצועי שוק המניות בישראל) לבין ביצועי קרן הסל בעלת סך הנכסים הגבוה ביותר הנכללת במדד במועד הקובע (המייצגת את ביצועי שוק המניות בארה"ב).

היה והמשקל הקבוצתי האחרון שחושב לקבוצת מניות ישראל היה 40% ומדד ת"א-125 הניב ביצועים עודפים של יותר מ-5% ביחס לקרן הסל בעלת סך הנכסים הגבוה ביותר הנכללת במדד, אזי משקל קבוצת מניות ישראל החל מהעדכון הקרוב יעמוד על 50% במדד (שינוי על 10% ביחס למצב הקודם), אחרת משקלות הקבוצות במדד יותרו ללא שינוי.

היה והמשקל הקבוצתי האחרון שחושב לקבוצת מניות ארה"ב היה 50% וקרן הסל בעלת סך הנכסים הגבוה ביותר הנכללת במדד הניבה ביצועים עודפים של יותר מ-5% ביחס למדד ת"א-125, אזי משקל קבוצת מניות ארה"ב החל מהעדכון הקרוב יעמוד על 60% במדד (שינוי על 10% ביחס למצב הקודם), אחרת משקלות הקבוצות במדד יותרו ללא שינוי.

כלומר, משקלה של קבוצה במדד לא יפחת מ-40% ולא יעלה על 60%. בפועל, משקלה של כל קבוצה במדד במועד הקובע עשוי להיות 40%, 50% או 60% בלבד.

משקלם של ניירות הערך בקבוצת מניות ישראל מבוסס על המשקל המקורי של כל נייר ערך במדד ת"א-125, אשר מתוקנן בהתאם לסטטוס המומנטום הנוכחי של הענף. נייר ערך המסווג בענף שנכלל בין 3 ענפי הבורסה בעלי דירוג מומנטום ענפי הגבוה ביותר, יקבל משקל עודף במדד ומנגד נייר ערך המסווג בענף שנכלל בין 3 ענפי הבורסה בעלי דירוג מומנטום ענפי הנמוך ביותר, יקבלו משקל חסר במדד.

"**דירוג מומנטום ענפי**" מחושב לפי סכימת ציוני המומנטום של כל ניירות הערך הנכללים בענף בורסה מסוים, כאשר ציון מומנטום של נייר ערך במדד מחושב על בסיס שער נייר הערך במועד הקובע ביחס לשער נייר הערך הממוצע ב-8 החודשים שקדמו למועד הקובע (50% מהציון) וליחס שבין שער נייר הערך הממוצע ב-50 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לבין שער נייר הערך הממוצע ב-200 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע (50% מהציון). הענף בעל היחס הגבוה ביותר ידורג בדירוג "1" ויחשב לענף המדורג בדירוג הגבוה ביותר. הענף בעל היחס השני הגבוה ביותר ידורג בדירוג "2" ויחשב לענף המדורג בדירוג השני הגבוה ביותר, וכן הלאה. ענפים בעלי יחס זהה ידורגו בדירוג זהה.

### מזהה המדד

סימול מדד: 6904.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך הנסחרים בישראל במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה, יחידות השתתפות בשותפות מוגבלת או יחידות השתתפות בקרן ריט (REIT).
- ניירות הערך רשומים למסחר בבורסה בישראל.

- ניירות הערך נקובים בש"ח.
- ניירות הערך הנכללים במדד יכללו במקביל במדד ת"א-125.
- להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך הנסחרים מחוץ לישראל במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:
  - ניירות הערך הם מסוג קרנות סל (ETF).
  - ניירות הערך רשומים למסחר באחת הבורסות בארה"ב.
  - ניירות הערך נקובים בדולר ארה"ב.
  - נכס הבסיס של קרנות סל (ETF) הוא מדד מניות העוקב על שוק המניות בארה"ב.
  - שווי נכסים נקי של קרן סל (ETF) במועד הקובע לא יפחת מ-1 מיליארד דולר ארה"ב.
  - קרנות סל (ETF) מקיימות את אחד מהתנאים הבאים: (1) שיעור העלות הכוללת בקרן (TER) במועד הקובע לא יעלה על 0.1%; (2) הפרש העקיבה השלילי בקרן ביחס למדד הייחוס של הקרן לא עלה על 0.1% במהלך 12 החודשים שקדמו למועד הקובע.
  - ועדת מדדים תגדיר את מספר קרנות סל (ETF) במדד במועד הקובע\* ובלבד שלא יפחת מ-5.
  - סינון קרנות סל (ETF) במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל קרנות סל (ETF) שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד.
- \* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר קרנות סל (ETF) במועד הקובע לא יעלה על 5.

### **עדכונים במדד**

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: חצי-שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iINDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

### **חישוב המדד**

- תחילת פרסום: 21/03/2022.
- התחלת שערים היסטוריים: 09/02/2017.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת ברוטו (GTR).
- מטבע חישוב: שקל חדש.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד מומנטום.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: 12%.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: אין.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: (1) משקלה של קבוצה במדד לא יפחת מ-40% ולא יעלה על 60%, וזאת על פי בחינת פער התשואה במועד הקובע בין ביצועי מדד ת"א-125 (המייצג את קבוצת מניות ישראל) לבין ביצועי קרן הסל בעלת סך הנכסים הגבוה ביותר הנכללת במדד במועד הקובע (המייצגת קבוצת מניות ארה"ב). (2) תיקנון פקטור מגבלת משקל של ניירות ערך במדד בהתאם למיקום דירוג מומנטום

ענפי: נייר ערך המסווג בענף שנכלל בין 3 ענפי הבורסה בעלי דירוג מומנטום ענפי הגבוה ביותר - פקטור 2X;  
נייר ערך המסווג בענף שנכלל בין 3 ענפי הבורסה בעלי דירוג מומנטום משוקלל ענפי ביותר - פקטור 0.5X.

### **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

### תמצית המדד

המדד כולל מניות של חברות ישראליות שנסחרות בבורסות האמריקאיות הממוקמות ברחוב וול-סטריט בעיר ניו-יורק בארה"ב.

### מזהה המדד

סימול מדד: 6201.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות.
- ניירות הערך רשומים למסחר בבורסות בארה"ב הממוקמות ברחוב וול סטריט בעיר ניו-יורק: בורסת ניו-יורק (NYSE) ובורסת נאסד"ק (NASDAQ). מניה שנסחרת הן בבורסה בת"א והן בבורסות בארה"ב לא תיכלל במדד.
- ניירות הערך נקובים בדולר ארה"ב.
- מנפיקי ניירות הערך משויכים לישראל בהתאם לסיווג iINDEX-Geo.
- שווי שוק ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-100 מיליון דולר ארה"ב.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-50,000 דולר ארה"ב.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-20.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.
- \* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 100.

### עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iINDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

### חישוב המדד

- תחילת פרסום: 18/06/2020.
- התחלת שיעורים היסטוריים: 29/12/2016.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת נטו (NTR).
- מטבע חישוב: דולר ארה"ב.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.

- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: בהתאם למפורט בפרק "תקריות משקל במדדי שווי שוק" להלן.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: אין.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: אין.

#### **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.



### תמצית המדד

המדד כולל מניות של חברות ישראליות שנסחרות בבורסות מחוץ לישראל ונמנות על תעשיות טכנולוגיה עילית ושירותים עתירי ידע בהייטק בישראל.

המונח "הייטק" מוגדר על ידי הלשכה המרכזית לסטטיסטיקה בישראל (הלמ"ס) בהתאם להגדרות ארגון ה-OECD וארגון ה-Eurostat, כרשימה של פעילויות כלכליות המסווגות לפי שני תחומים עיקריים: תעשיות טכנולוגיה עילית (ענפי תעשייה בתחום ההייטק) ושירותים עתירי ידע בהייטק (ענפי שירותים בתחום ההייטק).

### מזהה המדד

סימול מדד: 6102.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה, תעודות מניה אמריקאיות (ADR).
- ניירות הערך רשומים למסחר באחת מהבורסות במדינות הבאות: ארה"ב, קנדה, בריטניה, גרמניה, צרפת, הולנד, בלגיה, איטליה, ספרד, פורטוגל, אוסטרליה, לוקסמבורג, שווייץ. היה ונייר ערך נסחר במקביל הן בבורסה בישראל והן בבורסות מחוץ לישראל, נייר הערך לא יכלל במדד. אף על פי כן, היה ונמצא כי במועד הקובע, משקלם המצרפי של כל ניירות הערך שעמדו בכל יתר תנאי הסף של המדד ונסחרות בבורסה במדינה מסוימת כאמור לעיל לא עלה על 10%, כל ניירות הערך הנסחרים בבורסה במדינה מסוימת כאמור לעיל לא יכללו במדד בעדכון המדד הקרוב.
- ניירות הערך נקובים בדולר ארה"ב, דולר קנדי, לירה שטרלינג, אירו, פרנק שוויצרי.
- מנפיקי ניירות הערך משויכים לישראל בהתאם לסיווג iNDEX-Geo.
- מנפיקי ניירות הערך מסווגים באחד ממגזרי הפעילות הבאים: "שבבים", "ציוד טכנולוגי", "תוכנה", "שירותים טכנולוגיים" או באחת מקבוצות ההתמחות הענפית הבאות: "טכנולוגיות לתחומי האנרגיה", "שירותים טכנולוגיים בתחום הבריאות", "טכנולוגיות בתחום הנדל"ן", "פינטק", "תשלומים דיגיטליים", "קמעונאות מקוונת", "יצרני רכב חשמלי", "טכנולוגיות רכב", "שירותי צריכה מקוונים", "משחקים מקוונים", "חלל, תעופה וייצור ביטחוני", "טכנולוגיות תקשורת", בהתאם לסיווג iNDEX-Tree. אף על פי האמור לעיל, המדד עשוי לכלול גם מנפיקי ניירות ערך מסיווג ענפי שונה, ובלבד שמנפיקי ניירות הערך כאמור נבחנו באופן ספציפי על ידי עורך המדד ונמצאו כי למעלה מ-25% מהכנסותיהם נובעות מפעילויות "הייטק" ו/או שהן בעלות נתח שוק שלא יפחת מ-5% בתחום "הייטק". יובהר כי מספר מנפיקי ניירות הערך מסוג זה במדד לא יעלה על 10% ממספר מנפיקי ניירות הערך המירבי במדד במועד הקובע.
- שווי שוק ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-100 מיליון דולר ארה"ב.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-100,000 דולר ארה"ב.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-20.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.

\* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 60.

## **עדכונים במדד**

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iNDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

## **חישוב המדד**

- תחילת פרסום: 02/11/2020.
- התחלת שערים היסטוריים: 31/12/2015.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת נטו (NTR).
- מטבע חישוב: דולר ארה"ב.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: בהתאם למפורט בפרק "תקרות משקל במדדי שווי שוק" להלן.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: משקלן המצרפי של כל המניות שעיקר פעילותן בתחומים המפורטים לעיל לא יפחת מ-75% ממשקל המדד.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: אין.

## **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

### תמצית המדד

המדד כולל 50 מניות של חברות ישראליות הנסחרות בבורסה בישראל או בבורסות בארה"ב, בעלות דירוג הצמיחה והמומנטום הגבוה ביותר מבין כל המניות העומדות בתנאי הסף של המדד.

"**דירוג צמיחה רבעוני משוקלל**" מתבסס על חישוב הצמיחה הרבעונית הממוצעת בהכנסות בשנתיים שקדמו למועד הקובע לעדכון הרכב המדד של כל המניות העומדות בתנאי הסף של המדד, כאשר היה והצמיחה הרבעונית האחרונה של חברה מסוימת ביחס לרבעון המקביל אשתקד הייתה שלילית, מנייתה לא תיכלל במדד במועד העדכון הקרוב ולא תקבל דירוג צמיחה משוקלל.

נייר הערך בעל שיעור הצמיחה הגבוה ביותר ידורג בדירוג "1" ויחשב לנייר הערך בדירוג הגבוה ביותר. נייר הערך בעל שיעור הצמיחה השני ידורג בדירוג "2" ויחשב לנייר הערך בדירוג השני הגבוה ביותר, וכן הלאה. ניירות ערך בעל יחס זהה ידורגו בדירוג זהה.

"**דירוג מומנטום תשואה**" מחושב לפי היחס שבין המחיר הממוצע של נייר הערך ב-50 ימי המסחר האחרונים לבין המחיר ממוצע של נייר הערך ב-200 ימי המסחר האחרונים, של ניירות הערך העומדים בתנאי הסף של המדד. נייר הערך בעל היחס הגבוה ביותר ידורג בדירוג "1" ויחשב לנייר הערך המדורג בדירוג הגבוה ביותר. נייר הערך בעל היחס השני הגבוה ביותר ידורג בדירוג "2" ויחשב לנייר הערך המדורג בדירוג השני הגבוה ביותר, וכן הלאה. ניירות ערך בעלי יחס זהה ידורגו בדירוג זהה.

### מזהה המדד

סימול מדד: 6907.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה או יחידות השתתפות בשותפות מוגבלת.
- ניירות הערך רשומים למסחר בבורסה בישראל או באחת הבורסות בארה"ב. היה ונייר ערך נסחר במקביל הן בבורסה בישראל והן בבורסות מחוץ לישראל, יכלל במדד נייר ערך אשר נסחר בבורסה בישראל.
- ניירות הערך נקובים בש"ח או דולר ארה"ב.
- מנפיקי ניירות הערך משויכים לישראל בהתאם לסיווג iINDEX-Geo.
- שיעור החזקות הציבור של ניירות הערך במועד הקובע אינו פחות מ-20%.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-10,000 ש"ח.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\*.
- סינון ניירות הערך הנסחרים בבורסה בישראל במועד הקובע יבוצע תחילה לפי דירוג 100 החברות בעלות "דירוג צמיחה רבעוני משוקלל" הגבוה ביותר ולאחריו, יבוצע סינון נוסף לפי דירוג 50 החברות בעלות "דירוג מומנטום תשואה" הגבוה ביותר (מבין אותן 100 חברות "הצומחות ביותר").

\* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 50.

### עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.

- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iNDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

### **חישוב המדד**

- תחילת פרסום: 04/03/2024.
- התחלת שערים היסטוריים: 07/02/2020.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת נטו (NTR).
- מטבע חישוב: שקל חדש.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: 5%.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: אין.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: תיקנון פקטור מגבלת משקל של ניירות ערך במדד בהתאם לפרמטרים הבאים: (1) הציונים המנורמלים משקלול 2 הפרמטרים הבאים: צמיחה רבעונית בהכנסות ביחס לרבעונים קודמים ומומנטום התשואה של המניה - פקטור יחסי שבין 0.75 עד 1.5; (2) נייר ערך בעל מכפיל מכירות "קיצוני" (נכלל ב-2 העשירונים העליונים העליונים ביחס למכפילי המכירות של יתר ניירות הערך במדד) - פקטור 0.75.
- \*משקלם המצרפי של כל ניירות הערך הנסחרים בבורסות מחוץ לישראל לא יעלה על 40% ממשקל המדד במועד הקובע.

### **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

## תמצית המדד

המדד כולל מניות של חברות ישראליות הנסחרות בבורסה בישראל או בבורסות בארה"ב, המתמחות בתחומי שבבים וציוד טכנולוגי.

## מזהה המדד

סימול מדד: 6901.

## הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה או יחידות השתתפות בשותפות מוגבלת.
  - ניירות הערך רשומים למסחר בבורסה בישראל או באחת הבורסות בארה"ב. היה ונייר ערך נסחר במקביל הן בבורסה בישראל והן בבורסות מחוץ לישראל, יכלל במדד נייר ערך אשר נסחר בבורסה בישראל.
  - ניירות הערך נקובים בש"ח או דולר ארה"ב.
  - מנפיקי ניירות הערך משויכים לישראל בהתאם לסיווג iNDEX-Geo.
  - מנפיקי ניירות הערך מסווגים באחד ממגזרי הפעילות הבאים: "שבבים" או "ציוד טכנולוגי", בהתאם לסיווג iNDEX-Tree.
  - שיעור החזקות הציבור של ניירות הערך במועד הקובע אינו פוחת מ-20%.
  - התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-10,000 ש"ח.
  - ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-10.
  - ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך הנסחרים בבורסה בישראל במדד במועד הקובע\* ובלבד שלא יפחת מ-5.
  - סינון ניירות הערך הנסחרים בבורסה בישראל במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד הנסחרים בבורסה בישראל במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.
  - ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך הנסחרים בבורסות מחוץ לישראל במדד במועד הקובע\* ובלבד שלא יפחת מ-5.
  - סינון ניירות הערך הנסחרים בבורסות מחוץ לישראל במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד הנסחרים בבורסות מחוץ לישראל במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.
- \* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 50, מספר מנפיקי ניירות הערך הנסחרים בבורסה בישראל במועד הקובע לא יעלה על 25 ומספר מנפיקי ניירות הערך הנסחרים בבורסות מחוץ לישראל במועד הקובע לא יעלה על 25.

## עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: נייר ערך שנרשם למסחר אחרי המועד הקובע לעדכון הרכב המדד, עשוי להתווסף למדד בעדכון משקלות רבעוני במידה ושווי השוק הממוצע של נייר הערך במועד הקובע לעדכון המשקלות הרבעוני שווה או גבוה משווי השוק הממוצע של נייר ערך במיקום החציוני במדד על פי דירוג שווי שוק ממוצע במועד הקובע כאמור, ובלבד שבמועד הקובע כאמור חלפו 60 ימים ממועד הרישום של נייר הערך בבורסה ונייר הערך עומד בכל תנאי הסף של המדד במועד הקובע כאמור. בעת צירוף נייר ערך למדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב מדד, לא יגרע מהמדד נייר ערך אחר עד למועד עדכון הרכב המדד הבא.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iNDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

## חישוב המדד

- תחילת פרסום: 18/06/2020.
- התחלת שערים היסטוריים: 29/12/2016.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת ברוטו (GTR).
- מטבע חישוב: שקל חדש.
- מנגנון קביעת משקלות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: בהתאם למפורט בפרק "תקרות משקל במדדי שווי שוק" להלן.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: אין.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקלות: משקלם המצרפי של כל ניירות הערך הנסחרים בבורסה בישראל לא יפחת מ-60% ממשקל המדד במועד הקובע.

## שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

## תמצית המדד

המדד כולל מניות של חברות ישראליות הנסחרות בבורסה בישראל או בבורסות בארה"ב, המתמחות בתחומי התוכנה ושירותים טכנולוגיים.

## מזהה המדד

סימול מדד: 6902.

## הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה או יחידות השתתפות בשותפות מוגבלת.
  - ניירות הערך רשומים למסחר בבורסה בישראל או באחת הבורסות בארה"ב. היה ונייר ערך נסחר במקביל הן בבורסה בישראל והן בבורסות מחוץ לישראל, יכלל במדד נייר ערך אשר נסחר בבורסה בישראל.
  - ניירות הערך נקובים בש"ח או דולר ארה"ב.
  - מנפיקי ניירות הערך משויכים לישראל בהתאם לסיווג iNDEX-Geo.
  - מנפיקי ניירות הערך מסווגים באחד ממגזרי הפעילות הבאים: "תוכנה" או "שירותים טכנולוגיים", בהתאם לסיווג iNDEX-Tree.
  - שיעור החזקות הציבור של ניירות הערך במועד הקובע אינו פוחת מ-20%.
  - התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-10,000 ש"ח.
  - ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-10.
  - ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך הנסחרים בבורסה בישראל במדד במועד הקובע\* ובלבד שלא יפחת מ-5.
  - סינון ניירות הערך הנסחרים בבורסה בישראל במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד הנסחרים בבורסה בישראל במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.
  - ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך הנסחרים בבורסות מחוץ לישראל במדד במועד הקובע\* ובלבד שלא יפחת מ-5.
  - סינון ניירות הערך הנסחרים בבורסות מחוץ לישראל במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד הנסחרים בבורסות מחוץ לישראל במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.
- \* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 50, מספר מנפיקי ניירות הערך הנסחרים בבורסה בישראל במועד הקובע לא יעלה על 25 ומספר מנפיקי ניירות הערך הנסחרים בבורסות מחוץ לישראל במועד הקובע לא יעלה על 25.

## עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות ישראל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: נייר ערך שנרשם למסחר אחרי המועד הקובע לעדכון הרכב המדד, עשוי להתווסף למדד בעדכון משקלות רבעוני במידה ושווי השוק הממוצע של נייר הערך במועד הקובע לעדכון המשקלות הרבעוני שווה או גבוה משווי השוק הממוצע של נייר ערך במיקום החציוני במדד על פי דירוג שווי שוק ממוצע במועד הקובע כאמור, ובלבד שבמועד הקובע כאמור חלפו 60 ימים ממועד הרישום של נייר הערך בבורסה ונייר הערך עומד בכל תנאי הסף של המדד במועד הקובע כאמור. בעת צירוף נייר ערך למדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב מדד, לא יגרע מהמדד נייר ערך אחר עד למועד עדכון הרכב המדד הבא.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iNDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

## חישוב המדד

- תחילת פרסום: 18/06/2020.
- התחלת שערים היסטוריים: 31/12/2015.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת ברוטו (GTR).
- מטבע חישוב: שקל חדש.
- מנגנון קביעת משקלות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: בהתאם למפורט בפרק "תקרות משקל במדדי שווי שוק" להלן.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: אין.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקלות: משקלם המצרפי של כל ניירות הערך הנסחרים בבורסה בישראל לא יפחת מ-60% ממשקל המדד במועד הקובע.

## שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.



### תמצית המדד

המדד כולל מניות של חברות הנסחרות בארה"ב ובישראל אשר מתמחות בתעשיות ביטחוניות.

### מזהה המדד

סימול מדד: 6130.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה, יחידות השתתפות בשותפות מוגבלת או תעודת מניה אמריקאית (ADR).
  - ניירות הערך רשומים למסחר באחת מהבורסות במדינות הבאות: ישראל וארה"ב. היה ונייר ערך נסחר במקביל הן בבורסה בישראל והן בבורסות מחוץ לישראל, יכלל במדד נייר ערך אשר נסחר בבורסה בישראל.
  - ניירות הערך נקובים בדולר ארה"ב וש"ח.
  - מנפיקי ניירות הערך מסווגים בתחום התמחות "ייצור ביטחוני" בקבוצת ההתמחות הענפית "חלל, תעופה וייצור ביטחוני", בהתאם לסיווג iINDEX-Tree.
  - שווי שוק ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-40 מיליון דולר ארה"ב.
  - התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-10,000 ש"ח.
  - ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-20.
  - ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך הנסחרים בבורסה בישראל במדד במועד הקובע\* ובלבד שלא יפחת מ-5.
  - סינון ניירות הערך הנסחרים בבורסה בישראל במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד הנסחרים בבורסה בישראל במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.
  - ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך הנסחרים בבורסות מחוץ לישראל במדד במועד הקובע\* ובלבד שלא יפחת מ-15.
  - סינון ניירות הערך הנסחרים בבורסות מחוץ לישראל במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד הנסחרים בבורסות מחוץ לישראל במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.
- \* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 40, מספר מנפיקי ניירות הערך הנסחרים בבורסה בישראל במועד הקובע לא יעלה על 15 ומספר מנפיקי ניירות הערך הנסחרים בבורסות מחוץ לישראל במועד הקובע לא יעלה על 25.

## עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובלי" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובלי" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iINDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

## חישוב המדד

- תחילת פרסום: 23/10/2023.
- התחלת שערים היסטוריים: 04/08/2018.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת נטו (NTR).
- מטבע חישוב: דולר ארה"ב.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: בהתאם למפורט בפרק "תקרות משקל במדדי שווי שוק" להלן.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: אין.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: משקלם המצרפי של כל ניירות הערך הנסחרים בבורסה בישראל לא יפחת מ-25% ממשקל המדד במועד הקובע.

## שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

### תמצית המדד

המדד כולל את 100 החברות בעלות שווי השוק הגבוה ביותר בעולם מבין כל המניות העומדות בתנאי הסף של המדד.

### מזהה המדד

סימול מדד: 6100.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה, יחידות השתתפות בשותפות מוגבלת, יחידות השתתפות בקרן ריט (REIT), תעודות מניה אמריקאיות (ADR), תעודות מניה גלובליות (GDR).
- ניירות הערך רשומים למסחר באחת מהבורסות במדינות הבאות: ארה"ב, קנדה, בריטניה, גרמניה, צרפת, הולנד, בלגיה, איטליה, ספרד, פורטוגל, יוון, אירלנד, אוסטרליה, לוקסמבורג, שוויץ, שבדיה, דנמרק, נורבגיה, פינלנד, יפן, סין (הונג קונג בלבד).
- ניירות הערך נקובים בדולר ארה"ב, דולר קנדי, לירה שטרלינג, אירו, פרנק שוויצרי, כתר שבדי, כתר דני, כתר נורבגי, ין יפני, דולר הונג קונג.
- שיעור החזקות הציבור של ניירות הערך במועד הקובע אינו פוחת מ-20%.
- שווי שוק ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-10 מיליארד דולר ארה"ב.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-1 מיליון דולר ארה"ב.
- מספר מנפיקי ניירות הערך במדד במועד הקובע יעמוד על 100.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך המירבי לסקטור כלכלי מסוים במדד\*.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.
- סינון ניירות הערך של מדינה מסוימת במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך המשויכים לאותה מדינה ויעמדו בכל תנאי הסף של המדד.
- סינון ניירות הערך של סקטור כלכלי מסוים במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שהונפקו על ידי מנפיקים באותו סקטור כלכלי מסוים ויעמדו בכל תנאי הסף של המדד.
- \* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר המנפיקים ממדינה מסוימת, למעט ארה"ב, לא יעלה 10 וכי מספר המנפיקים מסקטור מסוים לא יעלה על 30.

### עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.

- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iINDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

### **חישוב המדד**

- תחילת פרסום: 20/02/2024.
- התחלת שערים היסטוריים: 29/12/2016.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת נטו (NTR).
- מטבע חישוב: דולר ארה"ב.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: 6%.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.25%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: משקלן המצרפי של כל המניות הנכללות בסקטור כלכלי מסוים לא יעלה על 40% ממשקל המדד.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: אין.

### **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

### תמצית המדד

המדד כולל את 50 החברות שאינן אמריקאיות בעלות שווי השוק הגבוה ביותר בעולם מבין כל המניות העומדות בתנאי הסף של המדד.

### מזהה המדד

סימול מדד: 6150.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה, יחידות השתתפות בשותפות מוגבלת, יחידות השתתפות בקרן ריט (REIT), תעודות מניה אמריקאיות (ADR), תעודות מניה גלובליות (GDR).
- ניירות הערך רשומים למסחר באחת מהבורסות במדינות הבאות: ארה"ב, קנדה, בריטניה, גרמניה, צרפת, הולנד, בלגיה, איטליה, ספרד, פורטוגל, יוון, אירלנד, אוסטרליה, לוקסמבורג, שוויץ, שבדיה, דנמרק, נורבגיה, פינלנד, יפן, סין (הונג קונג בלבד).
- ניירות הערך נקובים בדולר ארה"ב, דולר קנדי, לירה שטרלינג, אירו, פרנק שוויצרי, כתר שבדי, כתר דני, כתר נורבגי, ין יפני, דולר הונג קונג.
- מנפיקי ניירות הערך המשויכים לארה"ב על פי סיווג עורך המדד בהתאם לאמור בפרק "תהליך שיוך גיאוגרפי של חברה" לא יכללו במדד.
- שיעור החזקות הציבור של ניירות הערך במועד הקובע אינו פוחת מ-20%.
- שווי שוק ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-10 מיליארד דולר ארה"ב.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-1 מיליון דולר ארה"ב.
- מספר מנפיקי ניירות הערך במדד במועד הקובע יעמוד על 50.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך המירבי המשויכים למדינה מסוימת במדד\*.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך המירבי לסקטור כלכלי מסוים במדד\*.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.
- סינון ניירות הערך של מדינה מסוימת במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך המשויכים לאותה מדינה ויעמדו בכל תנאי הסף של המדד.
- סינון ניירות הערך של סקטור כלכלי מסוים במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שהונפקו על ידי מנפיקים באותו סקטור כלכלי מסוים ויעמדו בכל תנאי הסף של המדד.
- \* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר המנפיקים ממדינה מסוימת לא יעלה 10 וכי מספר המנפיקים מסקטור מסוים לא יעלה על 20.

### עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.

- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iINDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

### **חישוב המדד**

- תחילת פרסום: 20/02/2024.
- התחלת שערים היסטוריים: 29/12/2016.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת נטו (NTR).
- מטבע חישוב: דולר ארה"ב.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: 8%.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.25%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: משקלן המצרפי של כל המניות הנכללות בסקטור כלכלי מסוים לא יעלה על 40% ממשקל המדד.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: אין.

### **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

### תמצית המדד

המדד כולל מניות הנסחרות בבורסות מחוץ לישראל ובעלות דירוג הערך הגבוה ביותר מבין כל המניות העומדות בתנאי הסף של המדד, כאשר דירוג זה מתבסס על מכפילי ההון (P/B), הרווח (P/E) ויחס שווי פעילות לרווח לפני הוצאות ריבית מס פחת והפחתות (EV/EBITDA).

"דירוג ערך משוקלל" מחושב באמצעות סכימת הערכים המנורמלים של היחסים הבאים בכל נייר ערך העומד בתנאי הסף של המדד במועד הקובע להרכב המדד: מכפיל הון (P/B), מכפיל רווח (P/E) ויחס שווי פעילות לרווח לפני הוצאות ריבית מס פחת והפחתות (EV/EBITDA).

נייר הערך בעל הציון הנמוך ביותר (דירוג ערך משוקלל הטוב ביותר) ידורג בדירוג "1" ויחשב לנייר הערך בדירוג הגבוה ביותר. נייר הערך בעל הציון השני ידורג בדירוג "2" ויחשב לנייר הערך בדירוג השני הגבוה ביותר, וכן הלאה. ניירות ערך בעל יחס זהה ידורגו בדירוג זהה.

### מזהה המדד

סימול מדד: 6145.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה, יחידות השתתפות בשותפות מוגבלת, יחידות השתתפות בקרן ריט (REIT), תעודות מניה אמריקאיות (ADR), תעודות מניה גלובליות (GDR).
- ניירות הערך רשומים למסחר באחת מהבורסות במדינות הבאות: ארה"ב, קנדה, בריטניה, גרמניה, צרפת, הולנד, בלגיה, איטליה, ספרד, פורטוגל, יוון, אירלנד, אוסטרליה, לוקסמבורג, שוויץ, שבדיה, דנמרק, נורבגיה, פינלנד, יפן, סין (הונג קונג בלבד), סינגפור, אוסטרליה.
- ניירות הערך נקובים בדולר ארה"ב, דולר קנדי, לירה שטרלינג, אירו, פרנק שוויצרי, כתר שבדי, כתר דני, כתר נורבגי, ין יפני, דולר הונג קונג, דולר סינגפורי, דולר אוסטרלי.
- שיעור החזקות הציבור של ניירות הערך במועד הקובע אינו פחות מ-20%.
- שווי שוק ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-2 מיליארד דולר ארה"ב. בנוסף, רק ניירות ערך אשר שווי השוק שלהם הינו בין 1,000 ניירות הערך בעל שווי השוק הגבוה ביותר מבין כל ניירות הערך שעמדו ביתר תנאי הסף, עשויים להיכלל במדד.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-1 מיליון דולר ארה"ב.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-100.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך המירבי המשוויכים למדינה מסוימת במדד\*.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך המירבי לסקטור כלכלי מסוים במדד\*.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג ערך משוקלל שמתבסס על היחסים הבאים בכל נייר ערך במועד הקובע: מכפיל הון (P/B), מכפיל רווח (P/E) ויחס שווי פעילות לרווח לפני הוצאות ריבית מס פחת והפחתות (EV/EBITDA). תחילה מתבצע נרמול בין 0 ל-1 של קבוצת ניירות הערך שערכיה נמוכים מהחציון (עבור כל יחס פיננסי בנפרד) ולאחר מכן, מדורגים ניירות הערך על פי דירוג ערך משוקלל מהחציון הנמוך ביותר (חיובי) לציון הגבוה ביותר (שלילי) באמצעות סכימת הערכים המנורמלים כאמור. יובהר כי במידה ואין מידע זמין על נייר ערך מסוים ו/או שהיחס הפיננסי שלו עולה על החציון - הציון שיקבל נייר הערך בפרמטר הנבחן הוא 1. בנוסף, יובהר כי הציון של מניות בנקים בגין היחס של EV/EBITDA מקובע על 0.5.
- סינון ניירות הערך של מדינה מסוימת במועד הקובע יבוצע לפי דירוג ערך משוקלל של כל ניירות הערך המשוויכים לאותה מדינה ויעמדו בכל תנאי הסף של המדד.

- סינון ניירות הערך של סקטור כלכלי מסוים במועד הקובע יבוצע לפי דירוג ערך משוקלל של כל ניירות הערך שהונפקו על ידי מנפיקים באותו סקטור כלכלי מסוים ויעמדו בכל תנאי הסף של המדד.

\* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 180, כי מספר המנפיקים ממדינה מסוימת, למעט ארה"ב, לא יעלה 10 וכי מספר המנפיקים מסקטור מסוים לא יעלה על 40.

### **עדכונים במדד**

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iINDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

### **חישוב המדד**

- תחילת פרסום: 17/06/2022.
- התחלת שיערים היסטוריים: 29/12/2016.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת נטו (NTR).
- מטבע חישוב: דולר ארה"ב.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: 3%.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: אין.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: תיקון פקטור מגבלת משקל של ניירות ערך במדד בהתאם לציונים המנורמלים משקלול 3 הפרמטרים הבאים: מכפיל הון (P/B), מכפיל רווח (P/E) ויחס שווי פעילות לרווח לפני הוצאות ריבית מס פחת והפחתות (EV/EBITDA) - פקטור יחסי שבין 0.75 עד 1.5.

### **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.



### תמצית המדד

המדד כולל מניות הנסחרות בבורסות מחוץ לישראל ובעלות דירוג הצמיחה הגבוה ביותר מבין כל המניות העומדות בתנאי הסף של המדד, כאשר דירוג זה מתבסס על הצמיחה הממוצעת בשנים האחרונות והצפי קדימה של החברות העומדות בתנאי הסף של המדד.

"דירוג צמיחה משוקלל" מחושב באמצעות סכימת הערכים המנורמלים של היחסים הבאים בכל נייר ערך העומד בתנאי הסף של המדד במועד הקובע להרכב המדד: תשואה על הנכסים (ROA) וצפי צמיחה עתידית (Future Growth).

נייר הערך בעל הציון הנמוך ביותר (דירוג צמיחה משוקלל הטוב ביותר) ידורג בדירוג "1" ויחשב לנייר הערך בדירוג הגבוה ביותר. נייר הערך בעל הציון השני ידורג בדירוג "2" ויחשב לנייר הערך בדירוג השני הגבוה ביותר, וכן הלאה. ניירות ערך בעל יחס זהה ידורגו בדירוג זהה.

### מזהה המדד

סימול מדד: 6146.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה, יחידות השתתפות בשותפות מוגבלת, יחידות השתתפות בקרן ריט (REIT), תעודות מניה אמריקאיות (ADR), תעודות מניה גלובליות (GDR).
- ניירות הערך רשומים למסחר באחת מהבורסות במדינות הבאות: ארה"ב, קנדה, בריטניה, גרמניה, צרפת, הולנד, בלגיה, איטליה, ספרד, פורטוגל, יוון, אירלנד, אוסטרליה, לוקסמבורג, שוויץ, שבדיה, דנמרק, נורבגיה, פינלנד, יפן, סין (הונג קונג בלבד), סינגפור, אוסטרליה.
- ניירות הערך נקובים בדולר ארה"ב, דולר קנדי, לירה שטרלינג, אירו, פרנק שוויצרי, כתר שבדי, כתר דני, כתר נורבגי, ין יפני, דולר הונג קונג, דולר סינגפורי, דולר אוסטרלי.
- שיעור החזקות הציבור של ניירות הערך במועד הקובע אינו פוחת מ-20%.
- שווי שוק ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-2 מיליארד דולר ארה"ב. בנוסף, רק ניירות ערך אשר שווי השוק שלהם הינו בין 1,000 ניירות הערך בעל שווי השוק הגבוה ביותר מבין כל ניירות הערך שעמדו ביתר תנאי הסף, עשויים להיכלל במדד.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-1 מיליון דולר ארה"ב.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-100.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך המירבי המשוויכים למדינה מסוימת במדד\*.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך המירבי לסקטור כלכלי מסוים במדד\*.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג צמיחה משוקלל שמתבסס על היחסים הבאים בכל נייר ערך במועד הקובע: תשואה על הנכסים (ROA) וצפי צמיחה עתידית (Future Growth). תחילה מתבצע נרמול בין 0 ל-1 של קבוצת ניירות הערך שערכיה גבוהים מהחציון (עבור כל יחס פיננסי בנפרד) ולאחר מכן, מדורגים ניירות הערך על פי דירוג צמיחה משוקלל מהציון הגבוה ביותר (חיובי) לציון הנמוך ביותר (שלילי) באמצעות סכימת הערכים המנורמלים כאמור. יובהר כי במידה ואין מידע זמין על נייר ערך מסוים ו/או שהיחס הפיננסי שלו נמוך מהחציון - הציון שיקבל נייר הערך בפרמטר הנבחן הוא 0. מתוך החברות שדירוגן בחציון העליון, רק חברות שעמדו במועד הקובע בצמיחה עקבית בהכנסות (4 מתוך 5 שנים עבור חברות בעלות נתונים עד 5 שנים ו-3 מתוך 5 שנים / 5 מתוך 7 שנים עבור חברות בעלות נתונים של יותר מ-5 שנים), עשויות להיכלל במדד. בשלב

הסינון האחרון יחושב לכל חברה ממוצע צמיחה בהכנסות ב-5 השנים שקדמו למועד הקובע וצפי צמיחה עתידית.

- סינון ניירות הערך של מדינה מסוימת במועד הקובע יבוצע לפי דירוג צמיחה משוקלל של כל ניירות הערך המשויכים לאותה מדינה ויעמדו בכל תנאי הסף של המדד.
  - סינון ניירות הערך של סקטור כלכלי מסוים במועד הקובע יבוצע לפי דירוג צמיחה משוקלל של כל ניירות הערך שהונפקו על ידי מנפיקים באותו סקטור כלכלי מסוים ויעמדו בכל תנאי הסף של המדד.
- \* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 180, כי מספר המנפיקים ממדינה מסוימת, למעט ארה"ב, לא יעלה 10 וכי מספר המנפיקים מסקטור מסוים לא יעלה על 40.

### **עדכונים במדד**

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iINDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

### **חישוב המדד**

- תחילת פרסום: 17/06/2022.
- התחלת שערים היסטוריים: 29/12/2016.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת נטו (NTR).
- מטבע חישוב: דולר ארה"ב.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: 3%.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: אין.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: תיקון פקטור מגבלת משקל של ניירות ערך במדד בהתאם לפרמטרים הבאים: (1) הציונים המנורמלים משקלול 3 הפרמטרים הבאים: צמיחה בהכנסות ביחס לשנה קודמת, צמיחה ברווח ביחס לשנה קודמת, צמיחה בתזרים ביחס לשנה קודמת - פקטור יחסי שבין 0.75 עד 1.5; (2) נייר ערך בעל מכפיל מכירות "קיצוני" (נכלל ב-2 העשירונים העליונים ביחס למכפילי המכירות של יתר ניירות הערך במדד) - פקטור 0.75.

### **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

### תמצית המדד

המדד כולל מניות הנסחרות בארה"ב ובעלות דירוג המומנטום הגבוה ביותר מבין כל המניות העומדות בתנאי הסף של המדד.

"דירוג מומנטום משוקלל" מחושב לפי היחסים המשוקללים של 2 הפרמטרים הבאים בכל נייר ערך במועד הקובע: (1) שער נייר הערך במועד הקובע ביחס לשער נייר הערך הממוצע ב-8 החודשים שקדמו למועד הקובע; (2) היחס שבין שער נייר הערך הממוצע ב-50 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לבין שער נייר הערך הממוצע ב-200 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע. נייר הערך בעל היחס הגבוה ביותר ידורג בדירוג "1" ויחשב לנייר הערך המדורג בדירוג הגבוה ביותר. נייר הערך בעל היחס השני הגבוה ביותר ידורג בדירוג "2" ויחשב לנייר הערך המדורג בדירוג השני הגבוה ביותר, וכן הלאה. ניירות ערך בעלי יחס זהה ידורגו בדירוג זהה.

### מזהה המדד

סימול מדד: 6227.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה, יחידות השתתפות בשותפות מוגבלת, יחידות השתתפות בקרן ריט (REIT), תעודות מניה אמריקאיות (ADR).
- ניירות הערך רשומים למסחר בבורסות בארה"ב.
- ניירות הערך נקובים בדולר ארה"ב.
- שיעור החזקות הציבור של ניירות הערך במועד הקובע אינו פוחת מ-20%.
- שווי שוק ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-2 מיליארד דולר ארה"ב.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-1 מיליון דולר ארה"ב.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-50.
- סינון ניירות הערך הראשוני במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר 750 ניירות הערך בעלי דירוג שווי השוק הממוצע הגבוה ביותר ידורגו לפי דירוג מומנטום משוקלל. ניירות ערך שיכללו בדירוג מומנטום משוקלל עשויים יגרעו מהדירוג במידה ונייר הערך נכלל בעשירון העליון ב-2 או יותר מבין הפרמטרים הבאים: מכפיל מכירות גבוה, שיעור חוב למאזן (רמת מינוף קיצונית) או סטיית תקן ב-12 החודשים שקדמו למועד הקובע (תנודתיות קיצונית).
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך המירבי לסקטור כלכלי מסוים במדד במועד הקובע\*.
- סינון ניירות הערך של סקטור כלכלי מסוים במועד הקובע יבוצע לפי דירוג מומנטום משוקלל של כל ניירות הערך שהונפקו על ידי מנפיקים באותו סקטור כלכלי מסוים ויעמדו בכל תנאי הסף של המדד.
- \* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 180 וכי מספר מנפיקי ניירות הערך לסקטור כלכלי מסוים במועד הקובע לא יעלה על 40.

### עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובלי" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובלי" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.

- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iNDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

### חישוב המדד

- תחילת פרסום: 17/06/2022.
- התחלת שערים היסטוריים: 29/12/2016.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת נטו (NTR).
- מטבע חישוב: דולר ארה"ב.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: 3%.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: אין.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: תיקון פקטור מגבלת משקל של ניירות ערך במדד בהתאם לפרמטרים הבאים: (1) הציונים המנורמלים משקלול הפרמטרים הבאים: תנודתיות גבוהה של נייר הערך במהלך 12 החודשים שחלפו טרם המועד הקובע ורמת המינוף של מנפיק נייר הערך במועד הקובע - פקטור יחסי שבין 0.5 עד 1; (2) נייר ערך בעל מכפיל מכירות "קיצוני" (נכלל ב-2 העשירונים העליונים ביחס למכפילי המכירות של יתר ניירות הערך במדד) - פקטור 0.75; (3) נייר ערך של מנפיק שאינו רווחי באופן עקבי (קרי, רשם רווח שנתי שלילי [הפסד] בשנתיים מתוך 3 השנים האחרונות שקדמו למועד הקובע, או לחילופין רשם רווח שנתי שלילי [הפסד] ב-3 מתוך 5 השנים האחרונות שקדמו למועד הקובע) - פקטור 0.75.

### שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

### תמצית המדד

המדד כולל מניות של חברות אמריקאיות כאשר כל אחד מבין הסקטורים המרכזיים מיוצג על ידי 5 המניות בעלות שווי השוק הגבוה ביותר מבין כל המניות מאותו סקטור ומשקל המניות במדד מוטה לטובת חברות המסווגות בסקטורים בעלי מומנטום תשואה חיובי (ביצועי מניות הסקטור בתקופה שקדמה לעדכון המדד גבוה ביחס ליתר הסקטורים במדד).

### מזהה המדד

סימול מדד: 6222.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה, יחידות השתתפות בשותפות מוגבלת, יחידות השתתפות בקרן ריט (REIT).
- ניירות הערך רשומים למסחר בבורסות בארה"ב.
- ניירות הערך נקובים בדולר ארה"ב.
- מנפיקי ניירות הערך משויכים לארה"ב בהתאם לסיווג iNDEX-Geo.
- שיעור החזקות הציבור של ניירות הערך במועד הקובע אינו פוחת מ-20%.
- שווי שוק ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-10 מיליארד דולר ארה"ב.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-1 מיליון דולר ארה"ב.
- מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 55 ומספר המנפיקים מסקטור מסוים לא יעלה על 5. קרי, במועד הקובע יכללו במדד עד 55 מנפיקי ניירות ערך אשר מייצגים את 11 הסקטורים בארה"ב.
- סינון ניירות הערך מסקטור מסוים במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך המירבי לסקטור במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-3. יובהר כי הסקטורים שיכללו במדד יתבססו על סיווג GICS.

### עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובלי" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובלי" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iNDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

### חישוב המדד

- תחילת פרסום: 31/12/2022.
- התחלת שיערים היסטוריים: 29/12/2016.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת נטו (NTR).
- מטבע חישוב: דולר ארה"ב.

- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: 10%
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: אין.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: במועד הקובע, יחושב בשלב הראשון לכל נייר ערך הנכלל במדד במועד הקובע ציון מומנטום על בסיס שער נייר הערך במועד הקובע ביחס לשער נייר הערך הממוצע ב-8 החודשים שקדמו למועד הקובע (50% מהציון) וליחס שבין שער נייר הערך הממוצע ב-50 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לבין שער נייר הערך הממוצע ב-200 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע (50% מהציון) ובשלב שני, יחושב לכל סקטור דירוג מומנטום ענפי על בסיס ציוני המומנטום המשוקללים של כל ניירות הערך במדד שהתקבלו בשלב הראשון. בשלב אחרון, יבוצע תיקנון פקטור מגבלת משקל של ניירות ערך במדד בהתאם לסקטור שלהם: נייר ערך הנכלל באחד מבין 3 הסקטורים בעלי דירוג מומנטום ענפי הגבוה ביותר במועד הקובע - פקטור 2X; נייר ערך הנכלל באחד מבין 3 הסקטורים בעלי דירוג מומנטום ענפי הנמוך ביותר במועד הקובע - פקטור 0.5X.

#### **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

### תמצית המדד

המדד כולל מניות של חברות אמריקאיות כאשר כל אחד מבין הסקטורים המרכזיים מיוצג על ידי 5 המניות בעלות שווי השוק הגבוה ביותר באותו סקטור ומשקל המניות במדד מוטה לטובת חברות מסקטורים בעלי דירוג תמחור המומנטום הגבוה ביותר.

"ציון תמחור נייר ערך" מחושב לפי היחס שבין מכפיל הרווח העתידי לבין מכפיל הרווח הנוכחי.

"דירוג מומנטום תשואה" מחושב לפי היחס שבין המחיר הממוצע של נייר הערך ב-50 ימי המסחר האחרונים לבין המחיר מממוצע של נייר הערך ב-200 ימי המסחר האחרונים, של ניירות הערך העומדים בתנאי הסף של המדד. נייר הערך בעל היחס הגבוה ביותר ידורג בדירוג "1" ויחשב לנייר הערך המדורג בדירוג הגבוה ביותר. נייר הערך בעל היחס השני הגבוה ביותר ידורג בדירוג "2" ויחשב לנייר הערך המדורג בדירוג השני הגבוה ביותר, וכן הלאה. ניירות ערך בעלי יחס זהה ידורגו בדירוג זהה.

"דירוג מומנטום תשואה משוקלל לסקטור" מחושב לפי דירוגי מומנטום התשואה של ניירות הערך הנכללים בסקטור מסוים בהתאם למשקלם היחסי באותו סקטור.

### מזהה המדד

סימול מדד: 6223.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה, יחידות השתתפות בשותפות מוגבלת, יחידות השתתפות בקרן ריט (REIT).
  - ניירות הערך רשומים למסחר בבורסות בארה"ב.
  - ניירות הערך נקובים בדולר ארה"ב.
  - מנפיקי ניירות הערך משויכים לארה"ב בהתאם לסיווג iNDEX-Geo.
  - שווי שוק ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-1 מיליארד דולר ארה"ב.
  - התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-250,000 דולר ארה"ב.
  - ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-30.
  - ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך המירבי לסקטור במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-3.
  - סינון ניירות הערך של סקטור מסוים במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שהונפקו על ידי מנפיקים באותו סקטור ויעמדו בכל תנאי הסף של המדד.
- \* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 55 ומספר המנפיקים מסקטור מסוים לא יעלה על 5. יובהר כי הסקטורים שיכללו במדד יתבססו על סיווג GICS.

### עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובלי" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובלי" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.

- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iINDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

### **חישוב המדד**

- תחילת פרסום: 13/11/2023.
- התחלת שערים היסטוריים: 29/12/2016.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת נטו (NTR).
- מטבע חישוב: דולר ארה"ב.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: בהתאם למפורט בפרק "תקריות משקל במדדי שווי שוק" להלן.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: אין.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: במועד הקובע, יחושב לכל נייר ערך "ציון תמחור נייר ערך", כאשר ציון שגדול מ-1 אך במקביל שואף ל-1 (כלומר, 1.05 הינו ציון עדיף על פני 1.2) נחשב לציון הגבוה ביותר. ציוני התמחור המשוקללים של ניירות הערך קובעים את דירוג התמחור היחסי של כל סקטור לפי סיווג GICS. עבור 5 הסקטורים בעלי דירוג התמחור היחסי הטוב ביותר, יחושב "דירוג מומנטום תשואה משוקלל לסקטור" ויבוצע תיקנון פקטור מגבלת משקל של ניירות הערך שנכללים ב-3 הסקטורים בעלי "דירוג מומנטום תשואה משוקלל לסקטור" הגבוה ביותר - פקטור 2X.

### **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.



### תמצית המדד

המדד כולל מניות אמריקאיות בעלות דירוג הערך הגבוה ביותר מבין המניות הנסחרות בארה"ב, כאשר דירוג זה מתבסס על מכפילי ההון (P/B), הרווח (P/E) ויחס שווי פעילות לרווח לפני הוצאות ריבית מס פחת והפחתות (EV/EBITDA) של החברות העומדות בתנאי הסף של המדד.

"דירוג ערך משוקלל" מחושב באמצעות סכימת הערכים המנורמלים של 3 היחסים הבאים בכל נייר ערך במועד הקובע להרכב המדד: מכפיל הון (P/B), מכפיל רווח (P/E) ויחס שווי פעילות לרווח לפני הוצאות ריבית מס פחת והפחתות (EV/EBITDA). תחילה מתבצע נרמול בין 0 ל-1 של קבוצת ניירות הערך שערכיה נמוכים מהחציון (עבור כל יחס פיננסי כאמור בנפרד) כאשר במידה ואין מידע זמין על נייר ערך מסוים ו/או שהיחס הפיננסי של נייר ערך מסוים עולה על החציון - החציון שיקבל נייר הערך ביחס כאמור הוא 1. עבור ניירות ערך של בנקים החציון בגין היחס של EV/EBITDA מקובע על 0.5.

נייר הערך בעל החציון הנמוך ביותר (דירוג ערך משוקלל הטוב ביותר) ידורג בדירוג "1" ויחשב לנייר הערך בדירוג הגבוה ביותר. נייר הערך בעל החציון השני ידורג בדירוג "2" ויחשב לנייר הערך בדירוג השני הגבוה ביותר, וכן הלאה. ניירות ערך בעל יחס זהה ידורגו בדירוג זהה.

### מזהה המדד

סימול מדד: 6221.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה, יחידות השתתפות בשותפות מוגבלת, יחידות השתתפות בקרן ריט (REIT).
- ניירות הערך רשומים למסחר בבורסות בארה"ב.
- ניירות הערך נקובים בדולר ארה"ב.
- מנפיקי ניירות הערך משויכים לארה"ב בהתאם לסיווג iINDEX-Geo.
- שיעור החזקות הציבור של ניירות הערך במועד הקובע אינו פוחת מ-20%.
- שווי שוק ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-1 מיליארד דולר ארה"ב. בנוסף, רק ניירות ערך אשר שווי השוק שלהן הינו בין 1,000 ניירות הערך בעל שווי השוק הגבוה ביותר מבין כל ניירות הערך שעמדו ביתר תנאי הסף, עשויים להיכלל במדד.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-1 מיליון דולר ארה"ב.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-50.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך המירבי לסקטור כלכלי מסוים במדד\*.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג ערך משוקלל שמתבסס על היחסים הבאים בכל נייר ערך במועד הקובע: מכפיל הון (P/B), מכפיל רווח (P/E) ויחס שווי פעילות לרווח לפני הוצאות ריבית מס פחת והפחתות (EV/EBITDA). תחילה מתבצע נרמול בין 0 ל-1 של קבוצת ניירות הערך שערכיה נמוכים מהחציון (עבור כל יחס פיננסי בנפרד) ולאחר מכן, מדורגים ניירות הערך על פי דירוג ערך משוקלל מהחציון הנמוך ביותר (חיובי) לחציון הגבוה ביותר (שלילי) באמצעות סכימת הערכים המנורמלים כאמור. יובהר כי במידה ואין מידע זמין על נייר ערך מסוים ו/או שהיחס הפיננסי שלו עולה על החציון - החציון שיקבל נייר הערך בפרמטר הנבחן הוא 1. בנוסף, יובהר כי החציון של מניות בנקים בגין היחס של EV/EBITDA מקובע על 0.5.
- סינון ניירות הערך של סקטור כלכלי מסוים במועד הקובע יבוצע לפי דירוג ערך משוקלל של כל ניירות הערך שהונפקו על ידי מנפיקים באותו סקטור כלכלי מסוים ויעמדו בכל תנאי הסף של המדד.

\* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 80 וכי מספר המנפיקים מסקטור מסוים לא יעלה על 15.

### **עדכונים במדד**

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובלי" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובלי" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iINDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

### **חישוב המדד**

- תחילת פרסום: 28/01/2022.
- התחלת שערים היסטוריים: 29/12/2016.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת נטו (NTR).
- מטבע חישוב: דולר ארה"ב.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד משקל אחיד.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: בהתאם למפורט בפרק "תקרות משקל במדדי שווי שוק" להלן.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: משקלן המצרפי של כל המניות הנכללות בסקטור כלכלי מסוים לא יעלה על 30% ממשקל המדד.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: תיקון פקטור מגבלת משקל של ניירות ערך במדד בהתאם לציונים המנורמלים של תנודתיות ניירות הערך במהלך 12 החודשים שחלפו טרם המועד הקובע - פקטור יחסי שבין 0.7 עד 1.3.

### **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

### תמצית המדד

המדד כולל מניות של חברות אמריקאיות כאשר כל אחד מבין הסקטורים המרכזיים מיוצג על ידי 5 המניות בדירוג הערך (Value) הגבוה ביותר מבין כל המניות מאותו סקטור שעמדו בתנאי הסף.

### מזהה המדד

סימול מדד: 6219.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה, יחידות השתתפות בשותפות מוגבלת, יחידות השתתפות בקרן ריט (REIT).
- ניירות הערך רשומים למסחר בבורסות בארה"ב.
- ניירות הערך נקובים בדולר ארה"ב.
- מנפיקי ניירות הערך משויכים לארה"ב בהתאם לסיווג iINDEX-Geo.
- שווי שוק ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-1 מיליארד דולר ארה"ב.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-250,000 דולר ארה"ב.
- מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 55 ומספר המנפיקים מסקטור מסוים לא יעלה 5.
- סינון ניירות הערך הראשוני במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר 50 המניות בעלות דירוג שווי השוק הממוצע הגבוה ביותר בכל סקטור בנפרד ידורגו לפי היחס בין מכפיל הרווח העתידי לבין מכפיל הרווח הנוכחי ויגרעו מהמדד כל ניירות הערך שאינם מדורגים במועד הקובע בדירוג 20 ניירות הערך בעלי היחס שגדול וקרוב ככל הניתן ל-1 מבין כל ניירות הערך בסקטור שלהם. בשלב הבא ידורגו כל ניירות הערך שנותרו בכל סקטור על פי היחסים הבאים: מכפיל הון, מכפיל מכירות ומכפיל תזרים מזומנים, כאשר הדירוג מבוצע על פי שיקלול הציונים המנומרים המתקבלים לכל נייר ערך מכל אחד מהיחסים (בכל יחס יש ציון בין 0 ל-1 שכל נייר ערך מקבל בהתאם לשאר ניירות הערך בסקטור שלו והמשקל של כל יחס הינו שליש בשיקלול הדירוג) ויגרעו מהמדד כל ניירות הערך שאינם מדורגים במועד הקובע בדירוג 5 ניירות הערך בעלי היחס האיכותי ביותר בשקלול הפרמטרים מבין כל ניירות הערך בסקטור שלהם. בתום השלב האחרון צפויים להתקבל עד 55 מניות המייצגות את 5 המניות בדירוג הערך (Value) הגבוה ביותר מבין כל המניות מאותו סקטור עבור 11 הסקטורים המרכזיים.
- מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 55 ומספר המנפיקים מסקטור מסוים לא יעלה 5. יובהר כי הסקטורים שיכללו במדד יתבססו על סיווג GICS.

### עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובלי" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובלי" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iINDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

## חישוב המדד

- תחילת פרסום: 10/05/2021.
- התחלת שערים היסטוריים: 31/12/2017.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת נטו (NTR).
- מטבע חישוב: דולר ארה"ב.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: 5%.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: אין.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: אין.

## שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

**תמצית המדד**

המדד כולל את 10 החברות בעלות שווי השוק הגבוה ביותר מבין המניות הנסחרות בבורסת נאסד"ק אשר מתמחות בתחומים טכנולוגיים.

**מזהה המדד**

סימול מדד: 6213

**הרכב ניירות הערך במדד**

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות ותעודות מניה אמריקאיות (ADR).
  - ניירות הערך רשומים למסחר בבורסת נאסד"ק בארה"ב.
  - ניירות הערך נקובים בדולר ארה"ב.
  - מנפיקי ניירות הערך מסווגים באחד ממגזרי הפעילות הבאים: "שבבים", "ציוד טכנולוגי", "תוכנה", "שירותים טכנולוגיים" או באחת מקבוצות ההתמחות הענפית הבאות: "טכנולוגיות לתחומי האנרגיה", "שירותים טכנולוגיים בתחום הבריאות", "טכנולוגיות בתחום הנדל"ך", "פינטק", "תשלומים דיגיטליים", "קמעונאות מקוונת", "יצרני רכב חשמלי", "טכנולוגיות רכב", "שירותי צריכה מקוונים", "משחקים מקוונים", "חלל, תעופה וייצור ביטחוני", "טכנולוגיות תקשורת", בהתאם לסיווג iINDEX-Tree.
  - שווי שוק ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-1 מיליארד דולר ארה"ב.
  - התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-250,000 דולר ארה"ב.
  - מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 10.
  - סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יכללו בו 10 החברות אשר יקיימו את התנאים הבאים: יכללו במדד 5 החברות בעלות שווי השוק הגבוה ביותר מבין כל המניות העומדות ביתר תנאי המדד; מבין המניות שיעמדו ביתר תנאי המדד ואינן 5 החברות בעלות שווי השוק הגבוה ביותר, רק מניות בעלות הכנסה שנתית צומחת (חיובית ביחס לקודמתה) במהלך שנתיים מתוך 3 השנים שקדמו למועד הקובע לעדכון המדד עשויות להיכלל במדד. מניה שאינה נכללת במדד במועד הקובע, עשויה להיכלל בו רק במידה שרשמה הכנסה שנתית צומחת (חיובית ביחס לקודמתה) בשיעור של יותר מ-10% במהלך כל אחת מבין 5 השנים שקדמו למועד הקובע ובעלת רווח חיובי שנתיים טרם המועד הקובע לעדכון המדד.
  - ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך המירבי למגזר פעילות מסוים במדד במועד הקובע\*.
  - סינון ניירות הערך של מגזר פעילות מסוים במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שהונפקו על ידי מנפיקים באותו מגזר פעילות מסוים ויעמדו בכל תנאי הסף של המדד.
- \* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך למגזר פעילות מסוים במועד הקובע לא יעלה על 3.

**עדכונים במדד**

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.

- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iINDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

### **חישוב המדד**

- תחילת פרסום: 23/11/2020.
- התחלת שערים היסטוריים: 28/12/2017.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת נטו (NTR).
- מטבע חישוב: דולר ארה"ב.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד משקל אחיד.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: בהתאם למפורט בפרק "תקריות משקל במדדי שווי שוק" להלן.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: אין.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: תיקון פקטור מגבלת משקל של ניירות ערך במדד עבור מנפיקים שלא רשמו רווח שנתי חיובי במשך שנתיים מתוך 3 השנים שקדמו לעדכון המדד או במשך 3 מתוך 5 השנים שקדמו לעדכון המדד - פקטור 0.5X.

### **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

### תמצית המדד

המדד כולל את 30 החברות האמריקאיות בעלות שווי השוק הגבוה ביותר אשר מתמחות בתחומים טכנולוגיים.

### מזהה המדד

סימול מדד: 6202.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות ותעודות מניה אמריקאיות (ADR).
- ניירות הערך רשומים למסחר בבורסות בארה"ב.
- ניירות הערך נקובים בדולר ארה"ב.
- מנפיקי ניירות הערך משויכים לארה"ב בהתאם לסיווג iNDEX-Geo.
- מנפיקי ניירות הערך מסווגים באחד ממגזרי הפעילות הבאים: "שבבים", "ציוד טכנולוגי", "תוכנה", "שירותים טכנולוגיים" או באחת מקבוצות ההתמחות הענפית הבאות: "טכנולוגיות לתחומי האנרגיה", "שירותים טכנולוגיים בתחום הבריאות", "טכנולוגיות בתחום הנדל"ן", "פינטק", "תשלומים דיגיטליים", "קמעונאות מקוונת", "יצרני רכב חשמלי", "טכנולוגיות רכב", "שירותי צריכה מקוונים", "משחקים מקוונים", "חלל, תעופה וייצור ביטחוני", "טכנולוגיות תקשורת", בהתאם לסיווג iNDEX-Tree.
- שווי שוק ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-10 מיליארד דולר ארה"ב.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-250,000 דולר ארה"ב.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\*.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.
- \* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 30.

### עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iNDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

### חישוב המדד

- תחילת פרסום: 01/06/2020.
- התחלת שיערים היסטוריים: 28/12/2017.
- ערך בסיס: 1,000.

- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת נטו (NTR).
  - מטבע חישוב: דולר ארה"ב.
  - מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
  - תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: בהתאם למפורט בפרק "תקריות משקל במדדי שווי שוק" להלן.
  - משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
  - תקרת משקל ענפית במועד הקובע: אין.
  - פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: אין.
- שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**
- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
  - האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.



### תמצית המדד

המדד כולל את 30 החברות הסיניות בעלות שווי השוק הגבוה ביותר אשר מתמחות בתחומים טכנולוגיים.

### מזהה המדד

סימול מדד: 6702.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות ותעודות מניה אמריקאיות (ADR).
- ניירות הערך רשומים למסחר באחת מהבורסות במדינות הבאות: ארה"ב, סין (הונג קונג בלבד).
- ניירות הערך נקובים בדולר ארה"ב ודולר הונג קונג.
- מנפיקי ניירות הערך משויכים לסיין (כולל הונג קונג) בהתאם לסיווג iNDEX-Geo.
- מנפיקי ניירות הערך מסווגים באחד ממגזרי הפעילות הבאים: "שבבים", "ציוד טכנולוגי", "תוכנה", "שירותים טכנולוגיים" או באחת מקבוצות ההתמחות הענפית הבאות: "טכנולוגיות לתחומי האנרגיה", "שירותים טכנולוגיים בתחום הבריאות", "טכנולוגיות בתחום הנדל"ן", "פינטק", "תשלומים דיגיטליים", "קמעונאות מקוונת", "יצרני רכב חשמלי", "טכנולוגיות רכב", "שירותי צריכה מקוונים", "משחקים מקוונים", "חלל, תעופה וייצור ביטחוני", "טכנולוגיות תקשורת", בהתאם לסיווג iNDEX-Tree.
- שווי שוק ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-1 מיליארד דולר ארה"ב.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-250,000 דולר ארה"ב.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\*.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.
- \* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 30.

### עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iNDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

### חישוב המדד

- תחילת פרסום: 02/11/2020.
- התחלת שערים היסטוריים: 28/12/2017.
- ערך בסיס: 1,000.

- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת נטו (NTR).
  - מטבע חישוב: דולר ארה"ב.
  - מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
  - תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: בהתאם למפורט בפרק "תקריות משקל במדדי שווי שוק" להלן.
  - משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
  - תקרת משקל ענפית במועד הקובע: אין.
  - פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: אין.
- שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**
- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
  - האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

### תמצית המדד

המדד כולל מניות של חברות גלובליות המתמחות בתחום המוליכים למחצה, תוך מתן משקל אחיד במועד הקובע לכל מניה במדד.

### מזהה המדד

סימול מדד: 6131.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה, תעודות מניה אמריקאיות (ADR), תעודות מניה גלובליות (GDR).
- ניירות הערך רשומים למסחר באחת מהבורסות במדינות הבאות: ארה"ב, קנדה, בריטניה, גרמניה, צרפת, הולנד, בלגיה, איטליה, ספרד, פורטוגל, יוון, אירלנד, אוסטרליה, לוקסמבורג, שווייץ, שבדיה, דנמרק, נורבגיה, פינלנד, יפן, סין (הונג קונג בלבד), סינגפור, ישראל. היה ונייר ערך נסחר במקביל הן בבורסה בישראל והן בבורסות מחוץ לישראל, יכלול במדד נייר ערך אשר נסחר בבורסה בישראל.
- ניירות הערך נקובים בדולר ארה"ב, דולר קנדי, לירה שטרלינג, אירו, פרנק שוויצרי, כתר שבדי, כתר דני, כתר נורבגי, ין יפני, דולר הונג קונג, דולר סינגפורי, שקל חדש.
- מנפיקי ניירות הערך מסווגים במגזר הפעילות "שבבים", בהתאם לסיווג iINDEX-Tree.
- שווי שוק ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-100 מיליון דולר ארה"ב.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-250,000 דולר ארה"ב.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-20.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.
- \* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 40.

### עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iINDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

### חישוב המדד

- תחילת פרסום: 22/03/2021.
- התחלת שיערים היסטוריים: 28/12/2017.

- ערך בסיס: 1,000.
  - אופן החישוב: מדד תשואה כוללת נטו (NTR).
  - מטבע חישוב: דולר ארה"ב.
  - מנגנון קביעת משקולות: מדד משקל אחיד.
  - תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: 5%.
  - משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
  - תקרת משקל ענפית במועד הקובע: אין.
  - פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: אין.
- שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**
- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
  - האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

### תמצית המדד

המדד כולל את חברות השבבים הגלובליות בעלות סך ההכנסות הגבוה ביותר מבין המניות העומדות בתנאי המדד.

### מזהה המדד

סימול מדד: 6139.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה, יחידות השתתפות בשותפות מוגבלת, תעודות מניה אמריקאיות (ADR), תעודות מניה גלובליות (GDR).
- ניירות הערך רשומים למסחר באחת מהבורסות במדינות הבאות: ארה"ב, קנדה, בריטניה, גרמניה, צרפת, הולנד, בלגיה, איטליה, ספרד, פורטוגל, יוון, אירלנד, אוסטריה, לוקסמבורג, שוויץ, שבדיה, דנמרק, נורבגיה, פינלנד, יפן, סין (הונג קונג בלבד), סינגפור, ישראל. היה ונייר ערך נסחר במקביל הן בבורסה בישראל והן בבורסות מחוץ לישראל, יכלול במדד נייר ערך אשר נסחר בבורסה בישראל.
- ניירות הערך נקובים בדולר ארה"ב, דולר קנדי, לירה שטרלינג, אירו, פרנק שוויצרי, כתר שבדי, כתר דני, כתר נורבגי, ין יפני, דולר הונג קונג, דולר סינגפורי, שקל חדש.
- מנפיקי ניירות הערך מסווגים במגזר הפעילות "שבבים", בהתאם לסיווג INDEX-Tree.
- שווי שוק ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-100 מיליון דולר ארה"ב.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-250,000 דולר ארה"ב.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-20.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג הכנסות שנתיות של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד.

\* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 40.

### עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "INDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

### חישוב המדד

- תחילת פרסום: 21/06/2021.
- התחלת שערים היסטוריים: 29/12/2016.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת נטו (NTR).
- מטבע חישוב: דולר ארה"ב.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: 5%.

- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
  - תקרת משקל ענפית במועד הקובע: אין.
  - פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: אין.
- שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**
- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
  - האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

### תמצית המדד

המדד כולל מניות של חברות גלובליות המתמחות בתחומי שבבים על פי סיווג מערכת בינה מלאכותית (AI). המדד מבוסס על טכנולוגיה שפותחה באמצעות ניתוח שפה טבעית (NLP) של חברת הבינה המלאכותית AI21 במטרה לאתר ולסווג מניות של חברות בהתאם לפעילויות עסקיות שהוגדרו על ידי עורך המדד. במדד זה נוצר מודל NLP ייעודי שמטרתו לענות על השאלה איזה חברות פועלות בתחום השבבים, אשר מורכב מהפעילויות הבאות:

- **יצרני שבבים** - חברות המתמחות בייצור רכיבים אלקטרוניים בעלי תכונות של הולכה למחצה.
  - **ציוד לתחום השבבים** - חברות המתמחות בפיתוח וייצור של ציוד המשמש ליצירת מוליכים למחצה.
- קיום פעילות בתחומים הללו מוגדרת על ידי עורך המדד באמצעות עמידה בסף מינימלי של אחד מהפרמטרים הבאים: (1) לכל הפחות 40% הכנסות מצרפיות מתחומי הפעילות; (2) לכל הפחות 25% רווחיות גלומה מתחומי הפעילות; (3) לכל הפחות 5% נתח שוק בתחומי הפעילות; (4) לכל הפחות 3% השקעות מ"פ בתחומי הפעילות ביחס להכנסות החברה; (5) מיזוגים ורכישות בתחומי הפעילות מעל 10% משווי החברה בעת הרכישה/מיזוג ו/או רכישה/מיזוג בהיקף של 50 מיליון דולר ומעלה.
- אף על פי האמור לעיל, עיקר הפעילות של חברה בתחומים לעיל מוגדרת על ידי עורך המדד רק במידה ולפחות 50% מההכנסות המצרפיות של החברה תהיינה מהפעילויות לעיל. יובהר כי בתהליך קביעת משקלות המדד במועד הקובע, משקל המניות שעיקר פעילותן בתחומים המפורטים לעיל לא יפחת מ-75%.
- טכנולוגיה לניתוח שפה טבעית (NLP) היא למעשה אלגוריתם ממוחשב ומתוחכם מאוד שתהליך העיבוד שלו דומה לאופן שבני אדם מתקשרים זה עם זה ולא רק טקסט שמתורגם לשפת מכונה. במילים אחרות, מדובר במחשב שמסוגל לבצע מטלות בתחום השפה, כדוגמת תמצות של טקסט ארוך מאוד, תיקון דקדוק או מטלות אחרות שהוגדרו בצורה מדויקת ל"מכונה". במקרה דנן, מדובר בטכנולוגיה שפותחה לצורך סיווג ענפי של חברות. השלב הראשון ביצירת מודל NLP הוא שלב האימון, אשר אפשר להקבילו ללימוד דקדוק לשוני אצל ילדים. השלב השני של המודל הינו יצירת דאטה בצורת טקסט על כל חברה וטעינתו למערכת. בשלב זה המערכת מבצעת ניתוח שפה טבעית בהתאם למודל ומותירה את החברות אשר המונח "שבבים" ניתן כמענה לשאלה מה תחום הפעילות של החברה. בשלב אחרון מבצעת אינדקס תהליך בחינה נוסף לסיווג כל החברות שהתקבלו לגביהן תוצאת "שבבים". תהליך זה כולל בחינה של גורם אנושי וזאת כדי לוודא שאכן תחומי הפעילות של החברות תואמים את ההגדרה "שבבים". יובהר כי חברה שלא סווגה בתחום הפעילות של המדד על ידי טכנולוגיית AI לא תיכלל במדד.

אודות AI21 Labs - AI21 היא חברה המתמחה בפיתוח טכנולוגיות בינה מלאכותית. החברה הוקמה על ידי יואב שוהם פרופ' למדעי המחשב מסטנפורד, אורי גושן ומייסד מובילאיי פרופ' אמנון שעשוע. החברה מפתחת מודלים מקיפים לניתוח שפה טבעית (NLP). במסגרת זו, ניתן "לאמן" מודלים מותאמים לצרכים עסקיים כדוגמת סיווג פעילויות עסקיות, התמחויות ספציפיות, מיקוד גיאוגרפי ועוד. מעבדות ה-NLP של AI21 הן תוצר של שנים של תהליכי מחקר ופיתוח של חוקרי בינה מלאכותית מובילים בארץ ובחו"ל. למידע נוסף: [www.ai21.com](http://www.ai21.com)

### מזהה המדד

סימול מדד: 6120.

### הרכב ניירות הערך במדד

- להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:
- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, תעודות מניה אמריקאיות (ADR).

- ניירות הערך רשומים למסחר באחת מהבורסות במדינות הבאות: ארה"ב, גרמניה, צרפת, הולנד, בלגיה, איטליה, ספרד, פורטוגל, יוון, אירלנד, אוסטריה, לוקסמבורג, פינלנד.
- ניירות הערך נקובים בדולר ארה"ב, אירו.
- מנפיקי ניירות הערך מסווגים על ידי טכנולוגיית AI כבעלי פעילות בתחומים הבאים: יצרני שבבים, ציוד לתחום השבבים.
- שווי שוק ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-100 מיליון דולר ארה"ב.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-250,000 דולר ארה"ב.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-20.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד ובלבד שלכל הפחות 60% מכמות ניירות הערך במדד הן מניות שעיקר פעילותן בתחומים המפורטים לעיל.
- \* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 60.

### עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iINDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

### חישוב המדד

- תחילת פרסום: 02/09/2022.
- התחלת שערים היסטוריים: 31/12/2019.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת נטו (NTR).
- מטבע חישוב: דולר ארה"ב.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: 3%.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: משקלן המצרפי של כל המניות שעיקר פעילותן בתחומים המפורטים לעיל לא יפחת מ-75% ממשקל המדד.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: תיקון פקטור מגבלת משקל של ניירות ערך במדד בהתאם לציון המנורמל של דירוג ESG בקטגוריית "Environment" של מנפיק נייר הערך ביחס לדירוג ה-ESG בקטגוריית "Environment" של כל מנפיקי ניירות הערך הנכללים במדד - פקטור שבין 0.9 ל-1.1.

### שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? כן, פקטור מגבלת המשקל של ניירות ערך במדד מתוקן בהתאם לדירוג ESG בקטגוריית "Environment" של מנפיקי ניירות הערך.



### תמצית המדד

המדד כולל מניות של חברות אסייתיות שמתמחות בתחום השבבים (מוליכים למחצה).

### מזהה המדד

סימול מדד: 6709.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות.
- ניירות הערך רשומים למסחר באחת מהבורסות במדינות הבאות: יפן, סין (כולל הונג קונג), סינגפור, דרום קוריאה, טאיוואן. יצוין כי מניות הנסחרות בבורסות בסין (למעט בהונג קונג) הכלולות במדד הן מניות שרק משקיעים סיניים ומשקיעים זרים, שקיבלו אישור מיוחד מממשלת סין, רשאים לרוכשן.
- ניירות הערך נקובים בין יפני, דולר הונג קונגי, יואן סיני, דולר סינגפורי, דולר טאיוואני, וון קוריאני.
- מנפיקי ניירות הערך משויכים לאחת ממדינות אסיה בהתאם לסיווג iINDEX-Geo.
- מנפיקי ניירות הערך מסווגים במגזר פעילות "שבבים", בהתאם לסיווג iINDEX-Tree.
- שווי שוק ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-100 מיליון דולר ארה"ב.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-250,000 דולר ארה"ב.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-20.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.
- \* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 40.

### עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iINDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

### חישוב המדד

- תחילת פרסום: 22/02/2021.
- התחלת שערים היסטוריים: 29/12/2016.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת נטו (NTR).
- מטבע חישוב: דולר ארה"ב.

- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: בהתאם למפורט בפרק "תקרות משקל במדדי שווי שוק" להלן.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: אין.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: אין.

#### **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

### תמצית המדד

המדד כולל 10 חברות השבבים בעלות שווי השוק הגבוה ביותר מבין המניות הנסחרות בבורסות ארה"ב.

### מזהה המדד

סימול מדד: 6217.

### הרכב ניירות הערך במדד

- להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:
- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות ותעודות מניה אמריקאיות (ADR).
  - ניירות הערך רשומים למסחר בבורסות בארה"ב.
  - ניירות הערך נקובים בדולר ארה"ב.
  - מנפיקי ניירות הערך מסווגים במגזר פעילות "שבבים", בהתאם לסיווג iINDEX-Tree.
  - שווי שוק ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-1 מיליארד דולר ארה"ב.
  - התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-250,000 דולר ארה"ב.
  - מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 10.
  - סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.

### עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iINDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

### חישוב המדד

- תחילת פרסום: 22/03/2021.
- התחלת שיערי היסטוריים: 29/12/2016.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת נטו (NTR).
- מטבע חישוב: דולר ארה"ב.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: בהתאם למפורט בפרק "תקרות משקל במדדי שווי שוק" להלן.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: אין.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: אין.

### שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

### תמצית המדד

המדד כולל מניות של חברות גלובליות המתמחות בתחום הציוד לייצור שבבים. המונח "יצרני ציוד לשבבים" מתייחס לחברות המתמחות בפיתוח וייצור של ציוד המשמש ליצירת מוליכים למחצה ("שבבים").

### מזהה המדד

סימול מדד: 6129.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה, תעודות מניה אמריקאיות (ADR), תעודות מניה גלובליות (GDR).
- ניירות הערך רשומים למסחר באחת מהבורסות במדינות הבאות: ארה"ב, קנדה, בריטניה, גרמניה, צרפת, הולנד, בלגיה, איטליה, ספרד, פורטוגל, יוון, אירלנד, אוסטרליה, לוקסמבורג, שוויץ, שבדיה, דנמרק, נורבגיה, פינלנד, יפן, סין (הונג קונג בלבד), סינגפור, ישראל. היה ונייר ערך נסחר במקביל הן בבורסה בישראל והן בבורסות מחוץ לישראל, יכלול במדד נייר ערך אשר נסחר בבורסה בישראל.
- ניירות הערך נקובים בדולר ארה"ב, דולר קנדי, לירה שטרלינג, אירו, פרנק שוויצרי, כתר שבדי, כתר דני, כתר נורבגי, ין יפני, דולר הונג קונג, דולר סינגפורי, שקל חדש.
- מנפיקי ניירות הערך מסווגים בקבוצת ההתמחות הענפית "ציוד לשבבים", בהתאם לסיווג INDEX-Tree. אף על פי האמור לעיל, המדד עשוי לכלול גם מנפיקי ניירות ערך מסיווג ענפי שונה, ובלבד שמנפיקי ניירות הערך כאמור נבחנו באופן ספציפי על ידי עורך המדד ונמצאו כי למעלה מ-25% מהכנסותיהם נובעות מפעילויות "יצרני ציוד לשבבים" ו/או שהן בעלות נתח שוק שלא יפחת מ-5% בתחום "יצרני ציוד לשבבים". יובהר כי מספר מנפיקי ניירות הערך מסוג זה במדד לא יעלה על 10% ממספר מנפיקי ניירות הערך במדד המירבי במועד הקובע.
- שווי שוק ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-100 מיליון דולר ארה"ב.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-250,000 דולר ארה"ב.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-20.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.
- \* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 40.

### עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.

- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iINDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

### **חישוב המדד**

- תחילת פרסום: 15/03/2021.
- התחלת שערים היסטוריים: 29/12/2016.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת נטו (NTR).
- מטבע חישוב: דולר ארה"ב.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: בהתאם למפורט בפרק "תקרות משקל במדדי שווי שוק" להלן.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: משקלן המצרפי של כל המניות הנכללות בקבוצת ההתמחות הענפית "ציוד לשבבים" לא יפחת מ-75% ממשקל המדד.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: אין.

### **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

### תמצית המדד

המדד כולל מניות של חברות גלובליות המתמחות בתחום אבטחת הסייבר, תוך מתן משקל אחיד במועד הקובע לכל מניה במדד.

המונח "סייבר" מתייחס לחברות אשר עוסקות בפיתוח טכנולוגיות להגנה מאיומי סייבר.

### מזהה המדד

סימול מדד: 6116.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה, תעודות מניה אמריקאיות (ADR), תעודות מניה גלובליות (GDR).
- ניירות הערך רשומים למסחר באחת מהבורסות במדינות הבאות: ארה"ב, קנדה, בריטניה, גרמניה, צרפת, הולנד, בלגיה, איטליה, ספרד, פורטוגל, יוון, אירלנד, אוסטרליה, לוקסמבורג, שוויץ, שבדיה, דנמרק, נורבגיה, פינלנד, יפן, סין (הונג קונג בלבד), סינגפור, ישראל. היה ונייר ערך נסחר במקביל הן בבורסה בישראל והן בבורסות מחוץ לישראל, יכלול במדד נייר ערך אשר נסחר בבורסה בישראל.
- ניירות הערך נקובים בדולר ארה"ב, דולר קנדי, לירה שטרלינג, אירו, פרנק שוויצרי, כתר שבדי, כתר דני, כתר נורבגי, ין יפני, דולר הונג קונג, דולר סינגפורי, דולר שקל חדש.
- מנפיקי ניירות הערך מסווגים בקבוצת ההתמחות הענפית "אבטחת סייבר", בהתאם לסיווג INDEX-Tree. אף על פי האמור לעיל, המדד עשוי לכלול גם מנפיקי ניירות ערך מסיווג ענפי שונה, ובלבד שמנפיקי ניירות הערך כאמור נבחנו באופן ספציפי על ידי עורך המדד ונמצאו כי למעלה מ-25% מהכנסותיהם נובעות מפעילויות "סייבר" ו/או שהן בעלות נתח שוק שלא יפחת מ-5% בתחום "סייבר". יובהר כי מספר מנפיקי ניירות הערך מסוג זה במדד לא יעלה על 10% ממספר מנפיקי ניירות הערך המירבי במדד במועד הקובע.
- שווי שוק ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-100 מיליון דולר ארה"ב.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-250,000 דולר ארה"ב.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-20.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.

\* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 40.

### עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.

- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iINDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

### **חישוב המדד**

- תחילת פרסום: 03/12/2021.
- התחלת שיערים היסטוריים: 29/12/2016.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת נטו (NTR).
- מטבע חישוב: דולר ארה"ב.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד משקל אחיד.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: 5%.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: משקלן המצרפי של כל המניות הנכללות בקבוצת ההתמחות הענפית "אבטחת סייבר" לא יפחת מ-75% ממשקל המדד.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: אין.

### **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.



## תמצית המדד

המדד כולל מניית של חברות שנסחרות בארה"ב ומתמחות בתחומי סייבר על פי סיווג מערכת בינה מלאכותית. המדד מבוסס על טכנולוגיה שפותחה באמצעות ניתוח שפה טבעית (NLP) של חברת הבינה המלאכותית AI21 במטרה לאתר ולסווג מניות של חברות בהתאם לפעילויות עסקיות שהוגדרו על ידי עורך המדד. במדד זה נוצר מודל NLP ייעודי שמטרתו לענות על השאלה איזה חברות פועלות בתחום הסייבר, אשר מורכב מהפעילויות הבאות:

- **Cloud Security** - חברות המתמחות בפעילויות של אבטחה קיברנטית של מיחשוב ענן (Cloud Computing): פלטפורמות טכנולוגיות לסייבר למיחשוב ענן, תשתיות טכנולוגיות לתחום סייבר למיחשוב ענן ושירותי IT בתחום סייבר למיחשוב ענן.

בתחום זה יש התמחות משנה המכונה: **Cloud Security-SASE**. מדובר בחברות המתמחות בפתרונות אבטחה על גבי הענן אשר מציעות רשת תקשורת רחבה (WAN) ואבטחה כשירות מחשוב ענן ישירות למקור החיבור ולא למרכז נתונים.

- **Anti-Fraud Security** - חברות המתמחות בפיתוח פתרונות טכנולוגיים למניעת הונאות, זיופים ומעילות.
- **Computer/Web Security** - חברות המתמחות בפתרונות אבטחה למערכות מחשב ולשימושים באינטרנט.

קיום פעילות בתחומים הללו מוגדרת על ידי עורך המדד באמצעות עמידה בסף מינימלי של אחד מהפרמטרים הבאים: (1) לכל הפחות 40% הכנסות מצרפיות מתחומי הפעילות; (2) לכל הפחות 25% רווחיות גלומה מתחומי הפעילות; (3) לכל הפחות 5% נתח שוק בתחומי הפעילות; (4) לכל הפחות 3% השקעות מ"פ בתחומי הפעילות ביחס להכנסות החברה; (5) מיזוגים ורכישות בתחומי הפעילות מעל 10% משווי החברה בעת הרכישה/מיזוג ו/או רכישה/מיזוג בהיקף של 50 מיליון דולר ומעלה.

אף על פי האמור לעיל, עיקר הפעילות של חברה בתחומים לעיל מוגדרת על ידי עורך המדד רק במידה ולפחות 50% מההכנסות המצרפיות של החברה תהיינה מהפעילויות לעיל. יובהר כי בתהליך קביעת משקלות המדד במועד הקובע, משקל המניות שעיקר פעילותן בתחומים המפורטים לעיל לא יפחת מ-75%.

טכנולוגיה לניתוח שפה טבעית (NLP) היא למעשה אלגוריתם ממוחשב ומתוחכם מאוד שתהליך העיבוד שלו דומה לאופן שבני אדם מתקשרים זה עם זה ולא רק טקסט שמתורגם לשפת מכונה. במילים אחרות, מדובר במחשב שמסוגל לבצע מטלות בתחום השפה, כדוגמת תמצות של טקסט ארוך מאוד, תיקון דקדוק או מטלות אחרות שהוגדרו בצורה מדויקת ל"מכונה". במקרה דנן, מדובר בטכנולוגיה שפותחה לצורך סיווג ענפי של חברות. השלב הראשון ביצירת מודל NLP הוא שלב האימון, אשר אפשר להקבילו ללימוד דקדוק לשוני אצל ילדים. השלב השני של המודל הינו יצירת דאטה בצורת טקסט על כל חברה וטעינתו למערכת. בשלב זה המערכת מבצעת ניתוח שפה טבעית בהתאם למודל ומותירה את החברות אשר המונח "סייבר" ניתן כמענה לשאלה מה תחום הפעילות של החברה. בשלב אחרון מבצעת אינדקס תהליך בחינה נוסף לסיווג כל החברות שהתקבלו לגביהן תוצאת "סייבר". תהליך זה כולל בחינה של גורם אנושי וזאת כדי לוודא שאכן תחומי הפעילות של החברות תואמים את ההגדרה "סייבר". יובהר כי חברה שלא סווגה בתחום הפעילות של המדד על ידי טכנולוגיית AI לא תיכלל במדד.

אודות AI21 Labs - AI21 היא חברה המתמחה בפיתוח טכנולוגיות בינה מלאכותית. החברה הוקמה על ידי יואב שוהם פרופ' למדעי המחשב מסטנפורד, אורי גושן ומייסד מובילאיי פרופ' אמנון שעשועו. החברה מפתחת מודלים מקיפים לניתוח שפה טבעית (NLP). במסגרת זו, ניתן "לאמן" מודלים מותאמים לצרכים עסקיים כדוגמת סיווג פעילויות עסקיות, התמחויות ספציפיות, מיקוד גיאוגרפי ועוד. מעבדות ה-NLP של AI21 הן תוצר של שנים של תהליכי מחקר ופיתוח של חוקרי בינה מלאכותית מובילים בארץ ובח"ל. למידע נוסף: [www.ai21.com](http://www.ai21.com)

## מזהה המדד

סימול מדד: 6225.

## הרכב ניירות הערך במדד

- להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:
- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, תעודות מניה אמריקאיות (ADR).
  - ניירות הערך רשומים למסחר בבורסות בארה"ב.
  - ניירות הערך נקובים בדולר ארה"ב.
  - מנפיקי ניירות הערך מסווגים על ידי טכנולוגיית AI כבעלי פעילות בתחומים הבאים: Cloud Security, Computer/Web Security, Anti-Fraud Security.
  - שווי שוק ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-100 מיליון דולר ארה"ב.
  - התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-250,000 דולר ארה"ב.
  - ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-20.
  - סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג הכנסות שנתיות של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד.
- \* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 50.

## עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iNDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

## חישוב המדד

- תחילת פרסום: 17/01/2022.
- התחלת שיערי היסטוריים: 28/12/2017.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת נטו (NTR).
- מטבע חישוב: דולר ארה"ב.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד משקל אחיד.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: 6%.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: משקלן המצרפי של כל המניות שעיקר פעילותן בתחומים המפורטים לעיל לא יפחת מ-75% ממשקל המדד.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: אין.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: תיקון פקטור מגבלת משקל של ניירות ערך במדד בהתאם לפרמטרים הבאים: (1) תחום ההתמחות של מנפיק נייר הערך: Cloud Security-SASE - פקטור 2X; Anti-Fraud Security ו-Cloud Security - פקטור 1.5X; (2) הציון המנורמל של דירוג ESG בקטגוריית "אתיקה עסקית" של מנפיק נייר הערך ביחס לדירוג ה-ESG בקטגוריית "אתיקה עסקית" של כל מנפיקי ניירות הערך הנכללים במדד - פקטור שבין 0.9 ל-1.1; (3) נייר ערך בעל מכפיל רווח גולמי "קיצוני" (נכלל בעשירון העליון או בעשירון תחתון ביחס למכפילי הרווח הגולמי של יתר ניירות הערך במדד) - פקטור 0.9.

### שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? כן, פקטור מגבלת המשקל של ניירות ערך במדד מתוקנן בהתאם לדירוג ESG בקטגוריית "אתיקה עסקית" של מנפיקי ניירות הערך.

### תמצית המדד

המדד כולל 10 חברות המתמחות בתחום אבטחת הסייבר בעלות שווי השוק הגבוה ביותר מבין המניות הנסחרות בבורסות ארה"ב.

המונח "סייבר" מתייחס לחברות אשר עוסקות בפיתוח טכנולוגיות להגנה מאיומי סייבר.

### מזהה המדד

סימול מדד: 6224.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות ותעודות מניה אמריקאיות (ADR).
- ניירות הערך רשומים למסחר בבורסות בארה"ב.
- ניירות הערך נקובים בדולר ארה"ב.
- מנפיקי ניירות הערך מסווגים בקבוצת ההתמחות הענפית "אבטחת סייבר", בהתאם לסיווג iNDEX-Tree.
- שווי שוק ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-1 מיליארד דולר ארה"ב.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-250,000 דולר ארה"ב.
- מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 10.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.

### עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iNDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

### חישוב המדד

- תחילת פרסום: 20/02/2024.
- התחלת שיעורים היסטוריים: 29/12/2018.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת נטו (NTR).
- מטבע חישוב: דולר ארה"ב.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: בהתאם למפורט בפרק "תקרות משקל במדדי שווי שוק" להלן.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.

- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: אין.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: אין.

**שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

### תמצית המדד

המדד כולל מניית של חברות גלובליות שנסחרות בבורסות בארה"ב ומתמחות באבטחת סייבר למיחשוב ענן. המונח "סייבר למיחשוב ענן" מתייחס לשרשרת פעילויות הקשורות לאבטחה קיברנטית של מיחשוב ענן (Cloud Computing), כאשר תחום זה מורכב מחברות המתמחות בפיתוח וניהול פלטפורמות טכנולוגיות לסייבר למיחשוב ענן, תשתיות טכנולוגיות לתחום סייבר למיחשוב ענן ושירותי IT בתחום סייבר למיחשוב ענן.

- **פיתוח וניהול פלטפורמות טכנולוגיות לסייבר למיחשוב ענן** - חברות המתמחות בפיתוח פלטפורמות של אבטחת ענן ארגוני, אבטחת מידע ארגוני בגישה מרחוק, הגנת נקודות קצה בגישה מרחוק, אבטחת ותאימות IT בעבודה בסביבת ענן, ניהול זהויות דיגיטליות במיחשוב ענן וגישה מרחוק.
- **תשתיות טכנולוגיות לתחום סייבר למיחשוב ענן** - חברות המתמחות בפיתוח חומרה ופתרונות טכנולוגיים לאבטחת דוא"ל ומידע בגישה מרחוק, אבטחת מיחשוב ענן ותקשורת מובייל, אבטחת ביג דאטה בענן, אבטחת קוד פתוח במיחשוב ענן ואבטחת תשתיות מיחשוב מקצה לקצה בגישה מרחוק.
- **שירותי IT בתחום סייבר למיחשוב ענן** - חברות המתמחות בגילוי ומניעת איומי סייבר למיחשוב ענן, חקר ביצועים ואבטחת מיחשוב ענן, מתן פתרונות ושירותי אבטחת סייבר בגישה מרחוק, פיתוח וניהול פלטפורמות להערכת חשיפות סייבר בגישה מרחוק, פיתוח וניהול פלטפורמות זהות "חכמות" לעבודה בסביבת מיחשוב ענן. המניות אשר תיכללנה במדד הן של חברות אשר עורך המדד בחן אותן באופן ספציפי ומצא כי למעלה מ-25% מהכנסותיהן נובעות מהפעילויות המפורטות בתחומי ההתמחות המפורטים לעיל ו/או שהן בעלות נתח שוק שלא יפחת מ-5% באחת הפעילויות המפורטות בתחומי ההתמחות המפורטים לעיל.
- אף על פי האמור לעיל, עיקר הפעילות של חברה בתחומים לעיל מוגדרת על ידי עורך המדד רק במידה ולפחות 50% מההכנסות המצרפיות של החברה תהיינה מהפעילויות לעיל. יובהר כי בתהליך קביעת משקלות המדד במועד הקובע, משקל המניות שעיקר פעילותן בתחומים המפורטים לעיל לא יפחת מ-75%.

### מזהה המדד

סימול מדד: 6205.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה, תעודות מניה אמריקאיות (ADR).
- ניירות הערך רשומים למסחר בבורסות בארה"ב.
- ניירות הערך נקובים בדולר ארה"ב.
- מנפיקי ניירות הערך הם בעלי פעילות משמעותית בתחום אבטחת סייבר לאבטחת ענן, כאשר לכל הפחות הפעילויות הבאות מהוות למעלה מ-25% מהכנסות החברה בדוח התקופתי האחרון ו/או החברה מחזיקה בנתח שוק שלא יפחת מ-5% באחת מבין הפעילויות הבאות על פי דיווחיה או על פי נתונים פומביים: פיתוח וניהול פלטפורמות טכנולוגיות לסייבר למיחשוב ענן; תשתיות טכנולוגיות לתחום סייבר למיחשוב ענן; שירותי IT בתחום סייבר למיחשוב ענן.
- שווי שוק ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-100 מיליון דולר ארה"ב.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-250,000 דולר ארה"ב.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-20.

- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד ובלבד שלכל הפחות 60% מכמות ניירות הערך במדד הן מניות שעיקר פעילותן בתחומים המפורטים לעיל.

\* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 40.

### **עדכונים במדד**

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iNDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

### **חישוב המדד**

- תחילת פרסום: 18/06/2020.
- התחלת שיערים היסטוריים: 28/12/2017.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת נטו (NTR).
- מטבע חישוב: דולר ארה"ב.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: בהתאם למפורט בפרק "תקרות משקל במדדי שווי שוק" להלן.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: משקלן המצרפי של כל המניות שעיקר פעילותן בתחומים המפורטים לעיל לא יפחת מ-75% ממשקל המדד.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: אין.

### **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

### תמצית המדד

המדד כולל מניית של חברות שנסחרות בבורסות בארה"ב, המתמחות בפיתוח שירותים טכנולוגיים מקוונים לעבודה מרחוק.

המונח "Work From Home" מתייחס לגישה חדשה בשוק העבודה של ימינו, במסגרתה יותר ויותר עובדים שכירים עוברים לעבוד מהבית או ממקום שאינו המשרד הקבוע, וכן, יותר עצמאיים ועסקים מציעים את שירותיהם מרחוק, בין אם ללקוחות קצה ובין אם לעסקים אחרים. בהתאם לכך, מטרת המדד היא להתמקד במניית של חברות שמתמחות בפיתוח שירותים טכנולוגיים מקוונים לעבודה מרחוק.

הכללת מניה במדד תיעשה על פי סיווג עורך המדד בהתאם לתחומי ההתמחויות הבאים של החברות הכלולות:

- **פלטפורמת עבודה מקוונת**
- **פלטפורמת אונליין לפרילנסרים**
- **שירותי מחשוב ענן לעבודה מרחוק**
- **שרותי IT מקוונים**

המניית אשר תיכללנה במדד הן של חברות אשר עורך המדד בחן אותן באופן ספציפי ומצא כי למעלה מ-25% מהכנסותיהן נובעות מהפעילויות המפורטות בתחומי ההתמחות המפורטים לעיל ו/או שהן בעלות נתח שוק שלא יפחת מ-5% באחת הפעילויות המפורטות בתחומי ההתמחות המפורטים לעיל.

אף על פי האמור לעיל, עיקר הפעילות של חברה בתחומים לעיל מוגדרת על ידי עורך המדד רק במידה ולפחות 50% מהכנסות המצרפיות של החברה תהיינה מהפעילויות לעיל. יובהר כי בתהליך קביעת משקלות המדד במועד הקובע, משקל המניית שעיקר פעילותן בתחומים המפורטים לעיל לא יפחת מ-75%.

### מזהה המדד

סימול מדד: 6203.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניית רגילות, מניית בכורה, תעודות מניה אמריקאיות (ADR).
- ניירות הערך רשומים למסחר בבורסות בארה"ב.
- ניירות הערך נקובים בדולר ארה"ב.
- מנפיקי ניירות הערך הם בעלי פעילות משמעותית בתחום הפודטק, כאשר לכל הפחות הפעילויות הבאות מהוות למעלה מ-25% מהכנסות החברה בדוח התקופתי האחרון ו/או החברה מחזיקה בנתח שוק שלא יפחת מ-5% באחת מבין הפעילויות הבאות על פי דיווחיה או על פי נתונים פומביים: פלטפורמת עבודה מקוונת, פלטפורמת אונליין לפרילנסרים, שירותי מחשוב ענן לעבודה מרחוק, שרותי IT מקוונים.
- שווי שוק ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-1 מיליארד דולר ארה"ב.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-250,000 דולר ארה"ב.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-20.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד ובלבד שלכל הפחות 60% מכמות ניירות הערך במדד הן מניית שעיקר פעילותן בתחומים המפורטים לעיל.

\* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 50.



## **עדכונים במדד**

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iINDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

## **חישוב המדד**

- תחילת פרסום: 18/06/2020.
- התחלת שערים היסטוריים: 28/12/2017.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת נטו (NTR).
- מטבע חישוב: דולר ארה"ב.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: בהתאם למפורט בפרק "תקרות משקל במדדי שווי שוק" להלן.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: משקלן המצרפי של כל המניות שעיקר פעילותן בתחומים המפורטים לעיל לא יפחת מ-75% ממשקל המדד.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: אין.

## **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

### תמצית המדד

המדד כולל מניות של חברות שנסחרות בבורסות בארה"ב ומתמחות במיחשוב ענן (Cloud Computing). המונח "Cloud Computing" מתייחס לשימוש ההולך וגובר של אנשים פרטיים וחברות בטכנולוגיות של מיחשוב ענן, אשר מבוססות לרוב על שירותי חישוב ועיבוד בענן, אחסון מידע ובסיסי נתונים בענן וקישוריות בענן. תחום מיחשוב ענן מורכב מחברות המתמחות בפיתוח תשתיות ענן כשירות (IaaS), פלטפורמות ענן כשירות (PaaS) ותוכנות ענן כשירות (SaaS).

### מזהה המדד

סימול מדד: 6207.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה, תעודות מניה אמריקאיות (ADR).
- ניירות הערך רשומים למסחר בבורסות בארה"ב.
- ניירות הערך נקובים בדולר ארה"ב.
- מנפיקי ניירות הערך מסווגים בקבוצת ההתמחות הענפית "שירותי מיחשוב ענן", בהתאם לסיווג iNDEX-Tree. אף על פי האמור לעיל, המדד עשוי לכלול גם מנפיקי ניירות ערך מסיווג ענפי שונה, ובלבד שמנפיקי ניירות הערך כאמור נבחנו באופן ספציפי על ידי עורך המדד ונמצאו כי למעלה מ-25% מהכנסותיהם נובעות מפעילויות "Cloud Computing" ו/או שהן בעלות נתח שוק שלא יפחת מ-5% בתחום "Cloud Computing". יובהר כי מספר מנפיקי ניירות הערך מסוג זה במדד לא יעלה על 10% ממספר מנפיקי ניירות הערך המירבי במדד במועד הקובע.
- שווי שוק ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-100 מיליון דולר ארה"ב.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-250,000 דולר ארה"ב.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-20.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.
- \* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 40.

### עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iNDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

## **חישוב המדד**

- תחילת פרסום: 11/08/2020.
- התחלת שיערים היסטוריים: 29/12/2016.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת נטו (NTR).
- מטבע חישוב: דולר ארה"ב.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: בהתאם למפורט בפרק "תקרות משקל במדדי שווי שוק" להלן.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: משקלן המצרפי של כל המניות הנכללות בקבוצת ההתמחות הענפית "שירותי מיחשוב ענן" לא יפחת מ-75% ממשקל המדד.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: אין.

## **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

### תמצית המדד

המדד כולל מניות של חברות גלובליות המפתחות משחקי רשת ומשחקי וידאו, יצרניות של קונסולות משחקים ושבבים גרפיים.

המונח "eGaming" מתייחס לתחום המשחקים האלקטרוניים ומורכב מחברות המפתחות את המשחקים עצמם ויצרני החומרה שמהווה חלק בלתי נפרד מעולם המשחקים: שבבים לעיבוד גרפי והמכשיר האלקטרוני שבו מופעל המשחק (קונסולה).

### מזהה המדד

סימול מדד: 6107.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה, תעודות מניה אמריקאיות (ADR), תעודות מניה גלובליות (GDR).
- ניירות הערך רשומים למסחר באחת מהבורסות במדינות הבאות: ארה"ב, קנדה, בריטניה, גרמניה, צרפת, הולנד, בלגיה, איטליה, ספרד, פורטוגל, יוון, אירלנד, אוסטרליה, לוקסמבורג, שווייץ, שבדיה, דנמרק, נורבגיה, פינלנד, יפן, סין (הונג קונג בלבד), סינגפור, ישראל. היה ונייר ערך נסחר במקביל הן בבורסה בישראל והן בבורסות מחוץ לישראל, יכלול במדד נייר ערך אשר נסחר בבורסה בישראל.
- ניירות הערך נקובים בדולר ארה"ב, דולר קנדי, לירה שטרלינג, אירו, פרנק שוויצרי, כתר שבדי, כתר דני, כתר נורבגי, ין יפני, דולר הונג קונג, דולר סינגפורי, שקל חדש.
- מנפיקי ניירות הערך מסווגים בקבוצת ההתמחות הענפית "משחקים מקוונים", בהתאם לסיווג iINDEX-Tree. אף על פי האמור לעיל, המדד עשוי לכלול גם מנפיקי ניירות ערך מסיווג ענפי שונה, ובלבד שמנפיקי ניירות הערך כאמור נבחנו באופן ספציפי על ידי עורך המדד ונמצאו כי למעלה מ-25% מהכנסותיהם נובעות מפעילויות "eGaming" ו/או שהן בעלות נתח שוק שלא יפחת מ-5% בתחום "eGaming". יובהר כי מספר מנפיקי ניירות הערך מסוג זה במדד לא יעלה על 10% ממספר מנפיקי ניירות הערך המירבי במדד במועד הקובע.
- שווי שוק ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-100 מיליון דולר ארה"ב.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-250,000 דולר ארה"ב.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-20.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.
- \* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 40.

### עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.

- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iINDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

### **חישוב המדד**

- תחילת פרסום: 10/07/2020.
- התחלת שערים היסטוריים: 28/12/2017.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת נטו (NTR).
- מטבע חישוב: דולר ארה"ב.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: בהתאם למפורט בפרק "תקריות משקל במדדי שווי שוק" להלן.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: משקלן המצרפי של כל המניות הנכללות בקבוצת ההתמחות הענפית "משחקים מקוונים" לא יפחת מ-75% ממשקל המדד.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: תיקון פקטור מגבלת משקל של ניירות ערך במדד בהתאם שהכנסותיהן מתחום "eGaming" אינו עולה על 25% - פקטור X0.5.

### **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

### תמצית המדד

המדד כולל מניות של חברות גלובליות שמתמחות בתחום התשלומים הדיגיטליים. המונח "תשלומים דיגיטליים" מתייחס לתחום התשלומים הכספיים הנעשים באמצעים מקוונים או אלקטרוניים ואינם כרוכים באמצעים פיזיים כדוגמת מזומן או צ'קים. תחום התשלומים הדיגיטליים מורכב מחברות המתמחות בסליקת ועיבוד תשלומים דיגיטליים, שירותים ופתרונות קצה בתחום התשלומים הדיגיטליים ותשתיות טכנולוגיות לתחום התשלומים הדיגיטליים.

### מזהה המדד

סימול מדד: 6106.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה, תעודות מניה אמריקאיות (ADR), תעודות מניה גלובליות (GDR).
- ניירות הערך רשומים למסחר באחת מהבורסות במדינות הבאות: ארה"ב, קנדה, בריטניה, גרמניה, צרפת, הולנד, בלגיה, איטליה, ספרד, פורטוגל, יוון, אירלנד, אוסטרליה, לוקסמבורג, שוויץ, שבדיה, דנמרק, נורבגיה, פינלנד, ישראל. היה ונייר ערך נסחר במקביל הן בבורסה בישראל והן בבורסה מחוץ לישראל, יכלול במדד נייר ערך אשר נסחר בבורסה בישראל.
- ניירות הערך נקובים בדולר ארה"ב, דולר קנדי, לירה שטרלינג, אירו, פרנק שוויצרי, כתר שבדי, כתר דני, כתר נורבגי, שקל חדש.
- מנפיקי ניירות הערך מסווגים בקבוצת ההתמחות הענפית "תשלומים דיגיטליים", בהתאם לסיווג iINDEX-Tree. אף על פי האמור לעיל, המדד עשוי לכלול גם מנפיקי ניירות ערך מסיווג ענפי שונה, ובלבד שמנפיקי ניירות הערך כאמור נבחנו באופן ספציפי על ידי עורך המדד ונמצאו כי למעלה מ-25% מהכנסותיהם נובעות מפעילויות "תשלומים דיגיטליים" ו/או שהן בעלות נתח שוק שלא יפחת מ-5% בתחום "תשלומים דיגיטליים". יובהר כי מספר מנפיקי ניירות הערך מסוג זה במדד לא יעלה על 10% ממספר מנפיקי ניירות הערך המירבי במדד במועד הקובע.
- שווי שוק ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-100 מיליון דולר ארה"ב.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-250,000 דולר ארה"ב.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-20.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.
- \* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 40.

### עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.

- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iINDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

### **חישוב המדד**

- תחילת פרסום: 18/06/2020.
- התחלת שערים היסטוריים: 28/12/2017.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת נטו (NTR).
- מטבע חישוב: דולר ארה"ב.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: בהתאם למפורט בפרק "תקריות משקל במדדי שווי שוק" להלן.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: משקלן המצרפי של כל המניות הנכללות בקבוצת ההתמחות הענפית "תשלומים דיגיטליים" לא יפחת מ-75% ממשקל המדד.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: אין.

### **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

## תמצית המדד

המדד כולל 20 מניות של בנקים אמריקאיים גדולים ומתמחים בפעילות בנקאית מסורתית בארה"ב.

## מזהה המדד

סימול מדד: 6220.

## הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות.
- ניירות הערך רשומים למסחר בבורסות בארה"ב.
- ניירות הערך נקובים בדולר ארה"ב.
- מנפיקי ניירות הערך משויכים לארה"ב בהתאם לסיווג iNDEX-Geo.
- מנפיקי ניירות הערך מסווגים במגזר הפעילות "בנקים", בהתאם לסיווג iNDEX-Tree. בנוסף, מנפיקי ניירות הערך בעלי הכנסות שעולות על 25% בדוח התקופתי האחרון מתחום בנקאות מסורתית בארה"ב.
- שווי שוק ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-500 מיליון דולר ארה"ב.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-250,000 דולר ארה"ב.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-10.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.
- \* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 20.

## עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iNDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

## חישוב המדד

- תחילת פרסום: 01/07/2022.
- התחלת שערים היסטוריים: 01/06/2017.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת נטו (NTR).
- מטבע חישוב: דולר ארה"ב.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.



- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: בהתאם למפורט בפרק "תקריות משקל במדדי שווי שוק" להלן.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: אין.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: תיקון פקטור מגבלת משקל של ניירות ערך במדד בהתאם לציונים המשוקללים שיתקבלו מהפרמטרים הבאים: מכפיל הון (P/B), תשואה על ההון (ROE), מרווח ריביות (Net Interest Margin) ויחס יעילות (Efficiency Ratio) - פקטור בין 0.75 ל-1.5.

#### **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

### תמצית המדד

המדד כולל מניות של בורסות לניירות ערך הנסחרות בשווקים מפותחים בעולם. המונח "בורסה" מתייחס לחברות המתמחות בהפעלת וניהול בורסות לניירות ערך וסחורות.

### מזהה המדד

סימול מדד: 6108.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, תעודות מניה אמריקאיות (ADR), תעודות מניה גלובליות (GDR).
- ניירות הערך רשומים למסחר באחת מהבורסות במדינות הבאות: ארה"ב, קנדה, בריטניה, גרמניה, צרפת, הולנד, בלגיה, איטליה, ספרד, פורטוגל, יוון, אירלנד, אוסטרליה, לוקסמבורג, שוויץ, שבדיה, דנמרק, נורבגיה, פינלנד, יפן, סין (הונג קונג בלבד), סינגפור, אוסטרליה, ישראל. היה ונייר ערך נסחר במקביל הן בבורסה בישראל והן בבורסות מחוץ לישראל, יכלל במדד נייר ערך אשר נסחר בבורסה בישראל.
- ניירות הערך נקובים בדולר ארה"ב, דולר קנדי, לירה שטרלינג, אירו, פרנק שוויצרי, כתר שבדי, כתר דני, כתר נורבגי, ין יפני, דולר הונג קונג, דולר סינגפורי, דולר אוסטרלי, שקל חדש.
- מנפיקי ניירות הערך מסווגים בתחום התמחות "זירות מסחר ני"ע" בקבוצת ההתמחות הענפית "זירות מסחר ני"ע ומידע פיננסי", בהתאם לסיווג INDEX-Tree. אף על פי האמור לעיל, המדד עשוי לכלול גם מנפיקי ניירות ערך מסיווג ענפי שונה, ובלבד שמנפיקי ניירות הערך כאמור נבחנו באופן ספציפי על ידי עורך המדד ונמצאו כי למעלה מ-25% מהכנסותיהם נובעות מפעילויות "בורסות ני"ע" ו/או שהן בעלות נתח שוק שלא יפחת מ-5% בתחום "בורסות ני"ע". יובהר כי מספר מנפיקי ניירות הערך מסוג זה במדד לא יעלה על 10% ממספר מנפיקי ניירות הערך במדד המירבי במועד הקובע.
- שווי שוק ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-1 מיליארד דולר ארה"ב.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-250,000 דולר ארה"ב.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-10.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.
- \* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 20.

### עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.

- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iINDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

### **חישוב המדד**

- תחילת פרסום: 03/08/2020.
- התחלת שערים היסטוריים: 31/12/2015.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת נטו (NTR).
- מטבע חישוב: דולר ארה"ב.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: בהתאם למפורט בפרק "תקרות משקל במדדי שווי שוק" להלן.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: משקלן המצרפי של כל המניות הנכללות בתחום התמחות "זירות מסחר ני"ע" לא יפחת מ-75% ממשקל המדד.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: אין.

### **שיקולי אחריות תאגידי (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

## אינדקס REIT נדל"ן למגורים ארה"ב Top10



### תמצית המדד

המדד כולל את 10 מניות ה-REIT בעלות שווי השוק הגבוה ביותר מבין מניות ה-REIT הנסחרות בבורסות ארה"ב ומתמחות בהשקעה והחזקה של נדל"ן למגורים בארה"ב.

### מזהה המדד

סימול מדד: 6212.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג יחידות השתתפות בקרן ריט (REIT).
- ניירות הערך רשומים למסחר בבורסות בארה"ב.
- ניירות הערך נקובים בדולר ארה"ב.
- מנפיקי ניירות הערך מסווגים בקבוצת ההתמחות הענפית "נדל"ן למגורים", בהתאם לסיווג iINDEX-Tree.
- שווי שוק ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-500 מיליון דולר ארה"ב.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-250,000 דולר ארה"ב.
- מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 10.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.

### עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iINDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

### חישוב המדד

- תחילת פרסום: 05/07/2021.
- התחלת שערים היסטוריים: 31/12/2016.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת נטו (NTR).
- מטבע חישוב: דולר ארה"ב.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: בהתאם למפורט בפרק "תקרות משקל במדדי שווי שוק" להלן.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: אין.

- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: אין.

### **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

### תמצית המדד

המדד כולל מניות REIT שנסחרות בארה"ב ומתמחות בהשקעה והחזקה של נכסים קמעונאיים ומסחריים בארה"ב. המונח "Shopping Centers" מתייחס לנדל"ן קמעונאי המכיל את סוג הנכסים הבאים: קניונים, מרכזי קניות פתוחים ומרכזים מסחריים שכונתיים.

הכללת מניה במדד תיעשה על פי סיווג עורך המדד בהתאם לתחום הפעילות "מרכזי קניות (Shopping Centers)", אשר מורכב ממניות ריט שמתמחות ברכישה, פיתוח, בעלות, ליסינג, ניהול ותפעול של קניונים, מרכזי קניות אוטלט, מרכזי קניות שכונתיים וקהילתיים.

המניות אשר תיכללנה במדד הן של חברות אשר עורך המדד בחן אותן באופן ספציפי ומצא כי למעלה מ-50% מנכנסיהן המאזני או מהכנסותיהן נובעות מהפעילות המפורטת לעיל. בהתאם לכך, במדד יכללו רק חברות שעיקר פעילותן הינה בתחום Shopping Centers REIT.

### מזהה המדד

סימול מדד: 6214.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג יחידות השתתפות בקרן ריט (REIT).
- ניירות הערך רשומים למסחר בבורסות בארה"ב.
- ניירות הערך נקובים בדולר ארה"ב.
- מנפיקי ניירות הערך מסווגים בקבוצת ההתמחות הענפית "נדל"ן מסחרי ותעשייתי", בהתאם לסיווג INDEX-Tree.
- שווי שוק ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-500 מיליון דולר ארה"ב.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-250,000 דולר ארה"ב.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-10.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.
- \* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 30.

### עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iINDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

## **חישוב המדד**

- תחילת פרסום: 23/11/2020.
- התחלת שיערים היסטוריים: 31/12/2015.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת נטו (NTR).
- מטבע חישוב: דולר ארה"ב.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: בהתאם למפורט בפרק "תקריות משקל במדדי שווי שוק" להלן.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: משקלן המצרפי של כל המניות שעיקר פעילותן בתחומים המפורטים לעיל לא יפחת מ-75% ממשקל המדד.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: אין.

## **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

### תמצית המדד

המדד כולל מניות של חברות סיניות שמתמחות בתחומי הצריכה הבסיסית והמחזורית.

### מזהה המדד

סימול מדד: 6704.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות ותעודות מניה אמריקאיות (ADR).
- ניירות הערך רשומים למסחר באחת מהבורסות במדינות הבאות: סין (הונג קונג בלבד) וארה"ב.
- ניירות הערך נקובים בדולר הונג קונגי ודולר ארה"ב.
- מנפיקי ניירות הערך משויכים לסין (כולל הונג קונג) בהתאם לסיווג iINDEX-Geo.
- מנפיקי ניירות הערך מסווגים באחד מהסקטורים הכלכליים הבאים: "צריכה בסיסית" או "צריכה מחזורית", בהתאם לסיווג iINDEX-Tree.
- שווי שוק ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-100 מיליון דולר ארה"ב.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-250,000 דולר ארה"ב.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-20.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.
- \* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 40.

### עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iINDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

### חישוב המדד

- תחילת פרסום: 14/12/2020.
- התחלת שערים היסטוריים: 31/12/2015.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת נטו (NTR).
- מטבע חישוב: דולר ארה"ב.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.



- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: בהתאם למפורט בפרק "תקרות משקל במדדי שווי שוק" להלן.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: אין.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: אין.

#### **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

### תמצית המדד

המדד כולל את 10 יצרני המזון בעלי שווי השוק הגבוה ביותר מבין המניות העומדות בתנאי המדד.

### מזהה המדד

סימול מדד: 6137.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה, תעודות מניה אמריקאיות (ADR), תעודות מניה גלובליות (GDR).
- ניירות הערך רשומים למסחר באחת מהבורסות במדינות הבאות: ארה"ב, קנדה, בריטניה, גרמניה, צרפת, הולנד, בלגיה, איטליה, ספרד, פורטוגל, יוון, אירלנד, אוסטרליה, לוקסמבורג, שוויץ, שבדיה, דנמרק, נורבגיה, פינלנד, ישראל. היה ונייר ערך נסחר במקביל הן בבורסה בישראל והן בבורסה מחוץ לישראל, יכלול במדד נייר ערך אשר נסחר בבורסה בישראל.
- ניירות הערך נקובים בדולר ארה"ב, דולר קנדי, לירה שטרלינג, אירו, פרנק שוויצרי, כתר שבדי, כתר דני, כתר נורבגי, שקל חדש.
- מנפיקי ניירות הערך מסווגים בקבוצת ההתמחות הענפית "יצרני מזון", בהתאם לסיווג iINDEX-Tree.
- שווי שוק ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-1 מיליארד דולר ארה"ב.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-250,000 דולר ארה"ב.
- מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 10.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.

### עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iINDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

### חישוב המדד

- תחילת פרסום: 31/05/2021.
- התחלת שערים היסטוריים: 29/12/2016.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת נטו (NTR).
- מטבע חישוב: דולר ארה"ב.

- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: בהתאם למפורט בפרק "תקרות משקל במדדי שווי שוק" להלן.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: אין.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: אין.

#### **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

### תמצית המדד

המדד כולל את 10 החברות הגלובליות, אשר בבעלותן מותגי מזון ברחבי העולם, בעלות שווי השוק הגבוה ביותר מבין המניות העומדות בתנאי המדד.

המונח "Food Brands" מתייחס למותגי מזון אשר הושקו על ידי חברות המתמחות בייצור ועיבוד מזון, חברות המתמחות בייצור משקאות וחברות המתמחות בשירותי הסעדה כדוגמת רשתות מזון מהיר ורשתות בתי קפה.

### מזהה המדד

סימול מדד: 6113.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה, תעודות מניה אמריקאיות (ADR), תעודות מניה גלובליות (GDR).
- ניירות הערך רשומים למסחר באחת מהבורסות במדינות הבאות: ארה"ב, קנדה, בריטניה, גרמניה, צרפת, הולנד, בלגיה, איטליה, ספרד, פורטוגל, יוון, אירלנד, אוסטרליה, לוקסמבורג, שוויץ, שבדיה, דנמרק, נורבגיה, פינלנד, ישראל. היה ונייר ערך נסחר במקביל הן בבורסה בישראל והן בבורסות מחוץ לישראל, יכלול במדד נייר ערך אשר נסחר בבורסה בישראל.
- ניירות הערך נקובים בדולר ארה"ב, דולר קנדי, לירה שטרלינג, אירו, פרנק שוויצרי, כתר שבדי, כתר דני, כתר נורבגי, שקל חדש.
- מנפיקי ניירות הערך מסווגים באחת מבין קבוצות ההתמחות הענפית הבאות: "יצרני מזון", "יצרני משקאות", "מסעדות ובתי קפה", בהתאם לסיווג iNDEX-Tree.
- שווי שוק ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-1 מיליארד דולר ארה"ב.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-250,000 דולר ארה"ב.
- מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 10.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.

### עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iNDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

### חישוב המדד

- תחילת פרסום: 03/12/2021.

- התחלת שיערים היסטוריים: 31/05/2015.
  - ערך בסיס: 1,000.
  - אופן החישוב: מדד תשואה כוללת נטו (NTR).
  - מטבע חישוב: דולר ארה"ב.
  - מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
  - תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: בהתאם למפורט בפרק "תקריות משקל במדדי שווי שוק" להלן.
  - משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
  - תקרת משקל ענפית במועד הקובע: אין.
  - פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: אין.
- שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**
- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
  - האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

### תמצית המדד

המדד כולל מניות של חברות גלובליות שפעילות בתחום המזון והטיפול בחיות מחמד. המונח "Pets Care" מתייחס למגוון פעילויות אשר קשורות לעולמם של חיות המחמד, מייצור מזון וציוד רפואי, דרך קמעונאות מתמחה למוצרים המיועדים לחיות מחמד וכלה בתרופות שירותים וטרינריים. הכללת מניה במדד תיעשה על פי סיווג עורך המדד בהתאם לתחומי ההתמחויות הבאים של החברות הכלולות:

- יצרני מזון וציוד רפואי לחיות מחמד
- קמעונאות מתמחה לחיות מחמד
- תרופות ושירותים וטרינריים

המניות אשר תיכללנה במדד הן של חברות אשר עורך המדד בחן אותן באופן ספציפי ומצא כי למעלה מ-25% מהכנסותיהן נובעות מהפעילויות המפורטות בתחומי ההתמחות המפורטים לעיל ו/או שהן בעלות נתח שוק שלא יפחת מ-5% באחת הפעילויות המפורטות בתחומי ההתמחות המפורטים לעיל. אף על פי האמור לעיל, עיקר הפעילות של חברה בתחומים לעיל מוגדרת על ידי עורך המדד רק במידה ולפחות 50% מהכנסות המצרפיות של החברה תהיינה מהפעילויות לעיל. יובהר כי בתהליך קביעת משקלות המדד במועד הקובע, משקל המניות שעיקר פעילותן בתחומים המפורטים לעיל לא יפחת מ-75%.

### מזהה המדד

סימול מדד: 6105.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה, תעודות מניה אמריקאיות (ADR), תעודות מניה גלובליות (GDR).
- ניירות הערך רשומים למסחר באחת מהבורסות במדינות הבאות: ארה"ב, קנדה, בריטניה, גרמניה, צרפת, הולנד, בלגיה, איטליה, ספרד, פורטוגל, יוון, אירלנד, אוסטריה, לוקסמבורג, שוויץ, שבדיה, דנמרק, נורבגיה, פינלנד, ישראל. היה ונייר ערך נסחר במקביל הן בבורסה בישראל והן בבורסות מחוץ לישראל, יכלל במדד נייר ערך אשר נסחר בבורסה בישראל.
- ניירות הערך נקובים בדולר ארה"ב, דולר קנדי, לירה שטרלינג, אירו, פרנק שוויצרי, כתר שבדי, כתר דני, כתר נורבגי, שקל חדש.
- מנפיקי ניירות הערך הם בעלי פעילות משמעותית בתחום Pets Care, כאשר לכל הפחות הפעילויות הבאות מהוות למעלה מ-25% מהכנסות החברה בדוח התקופתי האחרון ו/או החברה מחזיקה בנתח שוק שלא יפחת מ-5% באחת מבין הפעילויות הבאות על פי דיווחיה או על פי נתונים פומביים: יצרני מזון וציוד רפואי לחיות מחמד; קמעונאות מתמחה לחיות מחמד; תרופות ושירותים וטרינריים.
- שווי שוק ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-100 מיליון דולר ארה"ב.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-250,000 דולר ארה"ב.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-20.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד ובלבד שלכל הפחות 60% מכמות ניירות הערך במדד הן מניות שעיקר פעילותן בתחומים המפורטים לעיל.

\* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 40.

## **עדכונים במדד**

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iNDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

## **חישוב המדד**

- תחילת פרסום: 14/12/2020.
- התחלת שערים היסטוריים: 31/12/2019.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת נטו (NTR).
- מטבע חישוב: דולר ארה"ב.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: בהתאם למפורט בפרק "תקרות משקל במדדי שווי שוק" להלן.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: משקלן המצרפי של כל המניות שעיקר פעילותן בתחומים המפורטים לעיל לא יפחת מ-75% ממשקל המדד.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: תיקון פקטור מגבלת משקל של ניירות ערך במדד בהתאם שהכנסותיהן מתחום "Pets Care" אינו עולה על 25% - פקטור X0.5.

## **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

## תמצית המדד

המדד כולל מניית של חברות שנסחרות בארה"ב ומתמחות בתחום הבריאות הדיגיטלית. המונח "בריאות דיגיטלית" מתייחס למגוון פעילויות הנוגעות לתחום הבריאות הדיגיטלית. בהתאם לכך, המדד מורכב ממניית של חברות שמפתחות ומייצרות מכשור רפואי דיגיטלי, מפתחות מערכות טכנולוגיות לניתוח נתוני בריאות, מספקות שירותים דיגיטליים לתחום הבריאות ושירותי רפואה מקוונת (Telemedicine).

הכללת מניה במדד תיעשה על פי סיווג עורך המדד בהתאם לתחומי ההתמחות הבאים של החברות הכלולות:

- **מכשור רפואי דיגיטלי** - חברות אשר מפתחות ומייצרות ציוד ומכשור רפואי עם יכולת שידור דיגיטלית של נתוני מידע למטופלים ו/או לבעלי תפקידים בתחום הרפואה.
- **ניתוח נתוני בריאות** - חברות המתמחות בפיתוח פלטפורמות טכנולוגיות כדוגמת מיחשוב ענן ובינה מלאכותית המיועדות לאיסוף, אחסון, ניטור וניתוח של מידע רפואי באמצעים דיגיטליים.
- **שירותים דיגיטליים לתחום הבריאות** - חברות המתמחות במתן שירותים דיגיטליים לתחום הבריאות, לרבות פתרונות טכנולוגיים לתהליכי ניהול עובדים, ספקים ומטופלים בתחום הבריאות, ביטוחי בריאות אונליין ואבטחת סייבר לתחום הבריאות הדיגיטלית.
- **שירותי רפואה מקוונת (Telemedicine)** - חברות המתמחות בפיתוח אמצעים דיגיטליים (פלטפורמת אינטרנט ומובייל) או במתן שירותי רפואה מקוונת.

המניית אשר תיכללנה במדד הן של חברות אשר עורך המדד בחן אותן באופן ספציפי ומצא כי למעלה מ-25% מהכנסותיהן נובעות מהפעילויות המפורטות בתחומי ההתמחות המפורטים לעיל ו/או שהן בעלות נתח שוק שלא יפחת מ-5% באחת הפעילויות המפורטות בתחומי ההתמחות המפורטים לעיל.

אף על פי האמור לעיל, עיקר הפעילות של חברה בתחומים לעיל מוגדרת על ידי עורך המדד רק במידה ולפחות 50% מההכנסות המצרפיות של החברה תהיינה מהפעילויות לעיל. יובהר כי בתהליך קביעת משקלות המדד במועד הקובע, משקל המניית שעיקר פעילותן בתחומים המפורטים לעיל לא יפחת מ-75%.

## מזהה המדד

סימול מדד: 6211.

## הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניית רגילות, מניית בכורה, תעודות מניה אמריקאיות (ADR).
- ניירות הערך רשומים למסחר בבורסות בארה"ב.
- ניירות הערך נקובים בדולר ארה"ב.
- מנפיקי ניירות הערך הם בעלי פעילות משמעותית בתחום הבריאות הדיגיטלית, כאשר לכל הפחות הפעילויות הבאות מהוות למעלה מ-25% מהכנסות החברה בדוח התקופתי האחרון ו/או החברה מחזיקה בנתח שוק שלא יפחת מ-5% באחת מבין הפעילויות הבאות על פי דיווחיה או על פי נתונים פומביים: מכשור רפואי דיגיטלי, ניתוח נתוני בריאות, שירותים דיגיטליים לתחום הבריאות, שירותי רפואה מקוונת (Telemedicine).
- שווי שוק ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-100 מיליון דולר ארה"ב.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-250,000 דולר ארה"ב.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-20.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד ובלבד שלכל הפחות 60% מכמות ניירות הערך במדד הן מניית שעיקר פעילותן בתחומים המפורטים לעיל.



\* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 40.

### **עדכונים במדד**

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iINDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

### **חישוב המדד**

- תחילת פרסום: 12/11/2020.
- התחלת שערים היסטוריים: 29/12/2016.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת נטו (NTR).
- מטבע חישוב: דולר ארה"ב.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: בהתאם למפורט בפרק "תקרות משקל במדדי שווי שוק" להלן.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: משקלן המצרפי של כל המניות שעיקר פעילותן בתחומים המפורטים לעיל לא יפחת מ-75% ממשקל המדד.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: אין.

### **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

### תמצית המדד

המדד כולל מניות של חברות גלובליות המתמחות בתחום טכנולוגיות מזון (FoodTech).

המונח "פודטק" מתייחס ליישומים טכנולוגיים שמשולבים כיום בעולם המזון, החל בטכנולוגיות המיועדות לשלבי ייצור ועיבוד מוצרי מזון טבעיים, תחליפי מזון, דרך פיתוח וייצור ציוד טכנולוגי לשימושים שונים בעולם המזון וכלה בטכנולוגיות המפותחות לצורך גידול וייצור רכיבי מזון.

הכללת מניה במדד תיעשה על פי סיווג עורך המדד בהתאם לתחומי ההתמחויות הבאים של החברות הכלולות:

- **ייצור ועיבוד מוצרי מזון טבעיים** - חברות המתמחות בייצור מזון ותוספי מזון טבעיים כולל פירות, ירקות, אגוזים ומוצרי חלב.
- **ייצור ושיווק תחליפי מזון** - חברות המתמחות בייצור ושיווק של תחליפי מזון מבוססי חלבון, סויה וכו'.
- **ציוד מתקדם לתחום ייצור ועיבוד מזון** - חברות המתמחות בייצור מכונות ייעודיות וציוד טכנולוגי המשמשים לקצירת יבולים, עיבוד מזון, מערכות השקיה ועיבוד קרקעות.
- **טכנולוגיות לגידול וייצור מזון** - חברות המתמחות בפיתוח פתרונות טכנולוגיים להנדסת, השבחת, ייצור ועיבוד של רכיבי מזון.

המניות אשר תיכללנה במדד הן של חברות אשר עורך המדד בחן אותן באופן ספציפי ומצא כי למעלה מ-25% מהכנסותיהן נובעות מהפעילויות המפורטות בתחומי ההתמחות המפורטים לעיל ו/או שהן בעלות נתח שוק שלא יפחת מ-5% באחת הפעילויות המפורטות בתחומי ההתמחות המפורטים לעיל.

אף על פי האמור לעיל, עיקר הפעילות של חברה בתחומים לעיל מוגדרת על ידי עורך המדד רק במידה ולפחות 50% מההכנסות המצרפיות של החברה תהיינה מהפעילויות לעיל. יובהר כי בתהליך קביעת משקלות המדד במועד הקובע, משקל המניות שעיקר פעילותן בתחומים המפורטים לעיל לא יפחת מ-75%.

### מזהה המדד

סימול מדד: 6136.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה, יחידות השתתפות בשותפות מוגבלת, תעודות מניה אמריקאיות (ADR), תעודות מניה גלובליות (GDR).
- ניירות הערך רשומים למסחר באחת מהבורסות במדינות הבאות: ארה"ב, קנדה, בריטניה, גרמניה, צרפת, הולנד, בלגיה, איטליה, ספרד, פורטוגל, יוון, אירלנד, אוסטרליה, לוקסמבורג, שווייץ, שבדיה, דנמרק, נורבגיה, פינלנד, יפן, סין (הונג קונג בלבד), סינגפור, ישראל. היה ונייר ערך נסחר במקביל הן בבורסה בישראל והן בבורסות מחוץ לישראל, יכלל במדד נייר ערך אשר נסחר בבורסה בישראל.
- ניירות הערך נקובים בדולר ארה"ב, דולר קנדי, לירה שטרלינג, אירו, פרנק שווייצרי, כתר שבדי, כתר דני, כתר נורבגי, ין יפני, דולר הונג קונג, דולר סינגפורי, שקל חדש.
- מנפיקי ניירות הערך הם בעלי פעילות משמעותית בתחום הפודטק, כאשר לכל הפחות הפעילויות הבאות מהוות למעלה מ-25% מהכנסות החברה בדוח התקופתי האחרון ו/או החברה מחזיקה בנתח שוק שלא יפחת מ-5% באחת מבין הפעילויות הבאות על פי דיווחיה או על פי נתונים פומביים: ייצור ועיבוד מוצרי מזון טבעיים; ייצור ושיווק תחליפי מזון; ציוד מתקדם לתחום ייצור ועיבוד מזון; טכנולוגיות לגידול וייצור מזון.
- שווי שוק ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-100 מיליון דולר ארה"ב.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-250,000 דולר ארה"ב.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-20.

- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד ובלבד שלכל הפחות 60% מכמות ניירות הערך במדד הן מניות שעיקר פעילותן בתחומים המפורטים לעיל.

\* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 40.

### **עדכונים במדד**

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iNDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

### **חישוב המדד**

- תחילת פרסום: 05/08/2021.
- התחלת שערים היסטוריים: 31/12/2018.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת נטו (NTR).
- מטבע חישוב: דולר ארה"ב.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: 6%.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: משקלן המצרפי של כל המניות שעיקר פעילותן בתחומים המפורטים לעיל לא יפחת מ-75% ממשקל המדד.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: אין.

### **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

### תמצית המדד

המדד כולל מניות של חברות גלובליות המתמחות בתחומי טכנולוגיות מזון (FoodTech) על פי סיווג מערכת בינה מלאכותית (AI).

המדד מבוסס על טכנולוגיה שפותחה באמצעות ניתוח שפה טבעית (NLP) של חברת הבינה המלאכותית AI21 במטרה לאתר ולסווג מניות של חברות בהתאם לפעילויות עסקיות שהוגדרו על ידי עורך המדד. במדד זה נוצר מודל NLP ייעודי שמטרתו לענות על השאלה איזה חברות פועלות בתחום הפודטק, אשר מורכב מהפעילויות הבאות:

- **Food Technology** - חברות המתמחות בפיתוח, ייצור ושיווק של פתרונות טכנולוגיים להנדסת, השבחת, ייצור ועיבוד של רכיבי מזון ותחליפי מזון מבוססי חלבון, סויה וכו'.
- **Flavors & Food Additives Manufacturing** - חברות המתמחות בייצור תמציות טעם, תוספי מזון ומשקאות אחרים באמצעות אמצעים אנליטיים מתקדמים.
- **Agricultural Technology** - חברות המתמחות במגוון פעילויות הקשורות לטכנולוגיות חקלאיות כגון: חקלאות סביבה מבוקרת ומדויקת, ביוטכנולוגיה חקלאית, רובוטיקה ואוטומציה.

קיום פעילות בתחומים הללו מוגדרת על ידי עורך המדד באמצעות עמידה בסף מינימלי של אחד מהפרמטרים הבאים: (1) לכל הפחות 40% הכנסות מצרפיות מתחומי הפעילות; (2) לכל הפחות 25% רווחיות גלומה מתחומי הפעילות; (3) לכל הפחות 5% נתח שוק בתחומי הפעילות; (4) לכל הפחות 3% השקעות מ"פ בתחומי הפעילות ביחס להכנסות החברה; (5) מיזוגים ורכישות בתחומי הפעילות מעל 10% משווי החברה בעת הרכישה/מיזוג ו/או רכישה/מיזוג בהיקף של 50 מיליון דולר ומעלה.

אף על פי האמור לעיל, עיקר הפעילות של חברה בתחומים לעיל מוגדרת על ידי עורך המדד רק במידה ולפחות 50% מההכנסות המצרפיות של החברה תהיינה מהפעילויות לעיל. יובהר כי בתהליך קביעת משקלות המדד במועד הקובע, משקל המניות שעיקר פעילותן בתחומים המפורטים לעיל לא יפחת מ-75%.

טכנולוגיה לניתוח שפה טבעית (NLP) היא למעשה אלגוריתם ממוחשב ומתוחכם מאוד שתהליך העיבוד שלו דומה לאופן שבני אדם מתקשרים זה עם זה ולא רק טקסט שמתורגם לשפת מכונה. במילים אחרות, מדובר במחשב שמסוגל לבצע מטלות בתחום השפה, כדוגמת תמצות של טקסט ארוך מאוד, תיקון דקדוק או מטלות אחרות שהוגדרו בצורה מדויקת ל"מכונה". במקרה דנן, מדובר בטכנולוגיה שפותחה לצורך סיווג ענפי של חברות. השלב הראשון ביצירת מודל NLP הוא שלב האימון, אשר אפשר להקבילו ללימוד דקדוק לשוני אצל ילדים. השלב השני של המודל הינו יצירת דאטה בצורת טקסט על כל חברה וטעינתו למערכת. בשלב זה המערכת מבצעת ניתוח שפה טבעית בהתאם למודל ומותירה את החברות אשר המונח "פודטק" ניתן כמענה לשאלה מה תחום הפעילות של החברה. בשלב אחרון מבצעת אינדקס תהליך בחינה נוסף לסיווג כל החברות שהתקבלו לגביהן תוצאת "פודטק". תהליך זה כולל בחינה של גורם אנושי וזאת כדי לוודא שאכן תחומי הפעילות של החברות תואמים את ההגדרה "פודטק". יובהר כי חברה שלא סווגה בתחום הפעילות של המדד על ידי טכנולוגיית AI לא תיכלל במדד.

אודות AI21 Labs - AI21 היא חברה המתמחה בפיתוח טכנולוגיות בינה מלאכותית. החברה הוקמה על ידי יואב שוהם פרופ' למדעי המחשב מסטנפורד, אורי גושן ומייסד מובילאיי פרופ' אמנון שעשוע. החברה מפתחת מודלים מקיפים לניתוח שפה טבעית (NLP). במסגרת זו, ניתן "לאמן" מודלים מותאמים לצרכים עסקיים כדוגמת סיווג פעילויות עסקיות, התמחויות ספציפיות, מיקוד גיאוגרפי ועוד. מעבדות ה-NLP של AI21 הן תוצר של שנים של תהליכי מחקר ופיתוח של חוקרי בינה מלאכותית מובילים בארץ ובח"ל. למידע נוסף: [www.ai21.com](http://www.ai21.com)

### מזהה המדד

סימול מדד: 6140.

## הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה, יחידות השתתפות בשותפות מוגבלת, תעודות מניה אמריקאיות (ADR).
- ניירות הערך רשומים למסחר באחת מהבורסות במדינות הבאות: ארה"ב, קנדה, בריטניה, גרמניה, צרפת, הולנד, בלגיה, איטליה, ספרד, פורטוגל, יוון, אירלנד, אוסטריה, לוקסמבורג, שוויץ, שבדיה, דנמרק, נורבגיה, פינלנד, יפן, סין (הונג קונג בלבד), סינגפור, ישראל. היה ונייר ערך נסחר במקביל הן בבורסה בישראל והן בבורסות מחוץ לישראל, יכלול במדד נייר ערך אשר נסחר בבורסה בישראל.
- ניירות הערך נקובים בדולר ארה"ב, דולר קנדי, לירה שטרלינג, אירו, פרנק שוויצרי, כתר שבדי, כתר דני, כתר נורבגי, ין יפני, דולר הונג קונג, דולר סינגפורי, שקל חדש.
- מנפיקי ניירות הערך מסווגים על ידי טכנולוגיית AI כבעלי פעילות בתחומים הבאים: Food Technology, Agricultural Technology, Flavors & Food Additives Manufacturing.
- שווי שוק ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-100 מיליון דולר ארה"ב.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-250,000 דולר ארה"ב.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-20.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד ובלבד שלכל הפחות 60% מכמות ניירות הערך במדד הן מניות שעיקר פעילותן בתחומים המפורטים לעיל.
- \* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 50.

## עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iINDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

## חישוב המדד

- תחילת פרסום: 10/06/2022.
- התחלת שערים היסטוריים: 31/12/2019.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת נטו (NTR).
- מטבע חישוב: דולר ארה"ב.
- מנגנון קביעת משקלות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: 5%.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: משקלן המצרפי של כל המניות שעיקר פעילותן בתחומים המפורטים לעיל לא יפחת מ-75% ממשקל המדד.

- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: תיקון פקטור מגבלת משקל של ניירות ערך במדד בהתאם לפרמטרים הבאים: (1) השיעור המנורמל של הצמיחה ברווח השנתי של מנפיק נייר הערך ביחס לצמיחה המשוקללת ברווח השנתי של כל מנפיקי ניירות הערך הנכללים במדד - פקטור שבין 0.75 ל-1.25; (2) השיעור המנורמל של מרווח ה-EBITDA של מנפיק נייר הערך ביחס למרווח ה-EBITDA המשוקלל של כל מנפיקי ניירות הערך הנכללים במדד - פקטור שבין 0.75 ל-1.25; (3) הציון המנורמל של דירוג ESG בקטגוריית "פליטת גזי חממה" של מנפיק נייר הערך ביחס לדירוג ה-ESG בקטגוריית "פליטת גזי חממה" של כל מנפיקי ניירות הערך הנכללים במדד - פקטור שבין 0.9 ל-1.1.

#### **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? כן, פקטור מגבלת המשקל של ניירות ערך במדד מתוקן בהתאם לדירוג ESG בקטגוריית "פליטת גזי חממה" של מנפיקי ניירות הערך.

### תמצית המדד

המדד כולל מניות של חברות גלובליות המתמחות בפיתוח ובייצור כלי רכב חשמליים.

### מזהה המדד

סימול מדד: 6114.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה, תעודות מניה אמריקאיות (ADR), תעודות מניה גלובליות (GDR).
- ניירות הערך רשומים למסחר באחת מהבורסות במדינות הבאות: ארה"ב, קנדה, בריטניה, גרמניה, צרפת, הולנד, בלגיה, איטליה, ספרד, פורטוגל, יוון, אירלנד, אוסטרליה, לוקסמבורג, שוויץ, שבדיה, דנמרק, נורבגיה, פינלנד, יפן, סין (הונג קונג בלבד), סינגפור, ישראל. היה ונייר ערך נסחר במקביל הן בבורסה בישראל והן בבורסות מחוץ לישראל, יכלול במדד נייר ערך אשר נסחר בבורסה בישראל.
- ניירות הערך נקובים בדולר ארה"ב, דולר קנדי, לירה שטרלינג, אירו, פרנק שוויצרי, כתר שבדי, כתר דני, כתר נורבגי, ין יפני, דולר הונג קונג, דולר סינגפורי, שקל חדש.
- מנפיקי ניירות הערך מסווגים בקבוצת ההתמחות הענפית "יצרני רכב חשמלי", בהתאם לסינון iINDEX-Tree. אף על פי האמור לעיל, המדד עשוי לכלול גם מנפיקי ניירות ערך מסיווג ענפי שונה, ובלבד שמנפיקי ניירות הערך כאמור נבחנו באופן ספציפי על ידי עורך המדד ונמצאו כי למעלה מ-25% מהכנסותיהם נובעות מפעילויות "רכב חשמלי" ו/או שהן בעלות נתח שוק שלא יפחת מ-5% בתחום "רכב חשמלי". יובהר כי מספר מנפיקי ניירות הערך מסוג זה במדד לא יעלה על 10.
- שווי שוק ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-100 מיליון דולר ארה"ב.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-250,000 דולר ארה"ב.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-20.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.
- \* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 40.

### עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iINDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

## **חישוב המדד**

- תחילת פרסום: 14/02/2020.
- התחלת שיערים היסטוריים: 28/03/2019.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת נטו (NTR).
- מטבע חישוב: דולר ארה"ב.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: בהתאם למפורט בפרק "תקריות משקל במדדי שווי שוק" להלן.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: משקלן המצרפי של כל המניות הנכללות בקבוצת ההתמחות הענפית "יצרני רכב חשמלי" לא יפחת מ-75% ממשקל המדד.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: תיקון פקטור מגבלת משקל של ניירות ערך במדד שמנפיקיהם אינם מסווגים בקבוצת ההתמחות הענפית "יצרני רכב חשמלי" - פקטור X0.5.

## **שיקולי אחריות תאגידי (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.



### תמצית המדד

המדד כולל מניות של חברות שנסחרות בבורסות בארה"ב ומתמחות בתחום הנסיעות והאירוח (Travel). המונח "Travel" מתייחס לשירותים העיקריים המהווים את תחום הנסיעות והאירוח כדוגמת חברות תעופה, בתי מלון ואתרי נופש, בתי קזינו, הפלגות נופש, פארקי שעשועים וטכנולוגיות ייעודיות לענף התיירות.

### מזהה המדד

סימול מדד: 6208.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה, תעודות מניה אמריקאיות (ADR).
- ניירות הערך רשומים למסחר בבורסות בארה"ב.
- ניירות הערך נקובים בדולר ארה"ב.
- מנפיקי ניירות הערך מסווגים באחת מקבוצות ההתמחות הענפית הבאות: "תיירות ונופש", "תחבורה אווירית", בהתאם לסיווג iINDEX-Tree. אף על פי האמור לעיל, המדד עשוי לכלול גם מנפיקי ניירות ערך מסיווג ענפי שונה, ובלבד שמנפיקי ניירות הערך כאמור נבחנו באופן ספציפי על ידי עורך המדד ונמצאו כי למעלה מ-25% מהכנסותיהם נובעות מפעילויות "Travel" ו/או שהן בעלות נתח שוק שלא יפחת מ-5% בתחום "Travel". יובהר כי מספר מנפיקי ניירות הערך מסוג זה במדד לא יעלה על 10% ממספר מנפיקי ניירות הערך המירבי במדד במועד הקובע.
- שווי שוק ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-100 מיליון דולר ארה"ב.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-250,000 דולר ארה"ב.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-20.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.
- \* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 40.

### עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iINDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

### חישוב המדד

- תחילת פרסום: 01/10/2020.

- התחלת שיערים היסטוריים: 31/12/2015.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת נטו (NTR).
- מטבע חישוב: דולר ארה"ב.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: בהתאם למפורט בפרק "תקריות משקל במדדי שווי שוק" להלן.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: משקלן המצרפי של כל המניות הנכללות בקבוצות ההתמחות הענפית "תיירות ונופש" ו-"תחבורה אווירית" לא יפחת מ-75% ממשקל המדד.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: תיקון פקטור מגבלת משקל של ניירות ערך במדד שאינן נכללות בקבוצות ההתמחות הענפית "תיירות ונופש" ו-"תחבורה אווירית" - פקטור X0.5.

#### **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

### תמצית המדד

המדד כולל מניות של חברות גלובליות המתמחות בתחומי התיירות על פי סיווג מערכת בינה מלאכותית (AI). המדד מבוסס על טכנולוגיה שפותחה באמצעות ניתוח שפה טבעית (NLP) של חברת הבינה המלאכותית AI21 במטרה לאתר ולסווג מניות של חברות בהתאם לפעילויות עסקיות שהוגדרו על ידי עורך המדד. במדד זה נוצר מודל NLP ייעודי שמטרתו לענות על השאלה איזה חברות פועלות בתחום התיירות, אשר מורכב מהפעילויות הבאות:

- **בתי מלון ואתרי נופש** - חברות המתמחות בתפעול וניהול בתי מלון, אתרי סקי, פארקי שעשועים והפלגות נופש.

- **סוכנות נסיעות מקוונת** - חברות המתמחות בבניית ותפעול אתרי אינטרנט, מובייל ואפליקציות המשמשים להזמנות כרטיסי תעופה וחופשות בבתי מלון ואתרי נופש.

קיום פעילות בתחומים הללו מוגדרת על ידי עורך המדד באמצעות עמידה בסף מינימלי של אחד מהפרמטרים הבאים: (1) לכל הפחות 40% הכנסות מצרפיות מתחומי הפעילות; (2) לכל הפחות 25% רווחיות גלומה מתחומי הפעילות; (3) לכל הפחות 5% נתח שוק בתחומי הפעילות; (4) לכל הפחות 3% השקעות מ"פ בתחומי הפעילות ביחס להכנסות החברה; (5) מיזוגים ורכישות בתחומי הפעילות מעל 10% משווי החברה בעת הרכישה/מיזוג ו/או רכישה/מיזוג בהיקף של 50 מיליון דולר ומעלה.

אף על פי האמור לעיל, עיקר הפעילות של חברה בתחומים לעיל מוגדרת על ידי עורך המדד רק במידה ולפחות 50% מההכנסות המצרפיות של החברה תהיינה מהפעילויות לעיל. יובהר כי בתהליך קביעת משקלות המדד במועד הקובע, משקל המניות שעיקר פעילותן בתחומים המפורטים לעיל לא יפחת מ-75%.

טכנולוגיה לניתוח שפה טבעית (NLP) היא למעשה אלגוריתם ממוחשב ומתוחכם מאוד שתהליך העיבוד שלו דומה לאופן שבני אדם מתקשרים זה עם זה ולא רק טקסט שמתורגם לשפת מכונה. במילים אחרות, מדובר במחשב שמסוגל לבצע מטלות בתחום השפה, כדוגמת תמצות של טקסט ארוך מאוד, תיקון דקדוק או מטלות אחרות שהוגדרו בצורה מדויקת "מכונה". במקרה דנן, מדובר בטכנולוגיה שפותחה לצורך סיווג ענפי של חברות. השלב הראשון ביצירת מודל NLP הוא שלב האימון, אשר אפשר להקבילו ללימוד דקדוק לשוני אצל ילדים. השלב השני של המודל הינו יצירת דאטה בצורת טקסט על כל חברה וטעינתו למערכת. בשלב זה המערכת מבצעת ניתוח שפה טבעית בהתאם למודל ומותירה את החברות אשר המונח "תיירות" ניתן כמענה לשאלה מה תחום הפעילות של החברה. בשלב אחרון מבצעת אינדקס תהליך בחינה נוסף לסיווג כל החברות שהתקבלו לגביהן תוצאת "תיירות". תהליך זה כולל בחינה של גורם אנושי וזאת כדי לוודא שאכן תחומי הפעילות של החברות תואמים את ההגדרה "תיירות". יובהר כי חברה שלא סווגה בתחום הפעילות של המדד על ידי טכנולוגיית AI לא תיכלל במדד.

אודות AI21 Labs - AI21 היא חברה המתמחה בפיתוח טכנולוגיות בינה מלאכותית. החברה הוקמה על ידי יואב שוהם פרופ' למדעי המחשב מסטנפורד, אורי גושן ומייסד מובילאיי פרופ' אמנון שעשוע. החברה מפתחת מודלים מקיפים לניתוח שפה טבעית (NLP). במסגרת זו, ניתן "לאמן" מודלים מותאמים לצרכים עסקיים כדוגמת סיווג פעילויות עסקיות, התמחויות ספציפיות, מיקוד גיאוגרפי ועוד. מעבדות ה-NLP של AI21 הן תוצר של שנים של תהליכי מחקר ופיתוח של חוקרי בינה מלאכותית מובילים בארץ ובח"ל. למידע נוסף: [www.ai21.com](http://www.ai21.com)

### מזהה המדד

סימול מדד: 6117.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, תעודות מניה אמריקאיות (ADR).
- ניירות הערך רשומים למסחר באחת מהבורסות במדינות הבאות: ארה"ב, קנדה, בריטניה, גרמניה, צרפת, הולנד, בלגיה, איטליה, ספרד, פורטוגל, יוון, אירלנד, אוסטריה, לוקסמבורג, שוויץ, שבדיה, דנמרק, נורבגיה, פינלנד, יפן, סין (הונג קונג בלבד), סינגפור, ישראל. היה ונייר ערך נסחר במקביל הן בבורסה בישראל והן בבורסות מחוץ לישראל, יכלול במדד נייר ערך אשר נסחר בבורסה בישראל.
- ניירות הערך נקובים בדולר ארה"ב, דולר קנדי, לירה שטרלינג, אירו, פרנק שוויצרי, כתר שבדי, כתר דני, כתר נורבגי, ין יפני, דולר הונג קונג, דולר סינגפורי, שקל חדש.
- מנפיקי ניירות הערך מסווגים על ידי טכנולוגיית AI כבעלי פעילות בתחומים הבאים: בתי מלון ואתרי נופש, סוכנות נסיעות מקוונת.
- שווי שוק ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-100 מיליון דולר ארה"ב.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-250,000 דולר ארה"ב.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-20.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד ובלבד שלכל הפחות 60% מכמות ניירות הערך במדד הן מניות שעיקר פעילותן בתחומים המפורטים לעיל.
- \* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 50.

### **עדכונים במדד**

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iINDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

### **חישוב המדד**

- תחילת פרסום: 13/02/2023.
- התחלת שערים היסטוריים: 31/12/2018.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת נטו (NTR).
- מטבע חישוב: דולר ארה"ב.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: 5%.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: משקלן המצרפי של כל המניות שעיקר פעילותן בתחומים המפורטים לעיל לא יפחת מ-75% ממשקל המדד.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: תיקון פקטור מגבלת משקל של ניירות ערך במדד בהתאם לפרמטרים הבאים: (1) הציון המנורמל של דירוג ESG כללי של מנפיק נייר הערך ביחס לדירוג ה-ESG הכללי של כל מנפיקי ניירות הערך הנכללים במדד - פקטור שבין 0.9 ל-1.1; (2) נייר ערך בעל מכפיל EV ל-Trailing EBITDA 12M "קיצוני" (שלילי או גבוה מ-30) - פקטור 0.9.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: אין.

### שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? כן, פקטור מגבלת המשקל של ניירות ערך במדד מתוקנן בהתאם לדירוג ESG כללי של מנפיקי ניירות הערך.

### תמצית המדד

המדד כולל מניות של חברות גלובליות המתמחות בתחומי אנרגיה ירוקה על פי סיווג מערכת בינה מלאכותית (AI).

המדד מבוסס על טכנולוגיה שפותחה באמצעות ניתוח שפה טבעית (NLP) של חברת הבינה המלאכותית AI21 במטרה לאתר ולסווג מניות של חברות בהתאם לפעילויות עסקיות שהוגדרו על ידי עורך המדד. במדד זה נוצר מודל NLP ייעודי שמטרתו לענות על השאלה איזה חברות פועלות בתחום האנרגיה הירוקה, אשר מורכב מהפעילויות הבאות:

- **Renewable Energy-Ecosystem** - חברות המתמחות בפיתוח וייצור של מערכות טכנולוגיות מתקדמות להפקה ושימור אנרגיה ירוקה כגון: סוללות מתקדמות, עמדות טעינה, תאי דלק וכו'.
- **Renewable Energy-Materials** - חברות המתמחות בהפקה, כרייה או ייצור של חומרים המשמשים כבסיס ליצירת אנרגיה ירוקה (ליתיום, אורניום, סיליקון וכו').
- **Renewable Energy-Production** - חברות המתמחות בהפקת אנרגיה ירוקה כגון: אנרגית רוח, אנרגיה סולארית (שמש), אנרגית מים ואנרגיה גיאותרמית (אדמה).

קיום פעילות בתחומים הללו מוגדרת על ידי עורך המדד באמצעות עמידה בסף מינימלי של אחד מהפרמטרים הבאים: (1) לכל הפחות 40% הכנסות מצרפיות מתחומי הפעילות; (2) לכל הפחות 25% רווחיות גלומה מתחומי הפעילות; (3) לכל הפחות 5% נתח שוק בתחומי הפעילות; (4) לכל הפחות 3% השקעות מ"פ בתחומי הפעילות ביחס להכנסות החברה; (5) מיזוגים ורכישות בתחומי הפעילות מעל 10% משווי החברה בעת הרכישה/מיזוג ו/או רכישה/מיזוג בהיקף של 50 מיליון דולר ומעלה.

אף על פי האמור לעיל, עיקר הפעילות של חברה בתחומים לעיל מוגדרת על ידי עורך המדד רק במידה ולפחות 50% מההכנסות המצרפיות של החברה תהיינה מהפעילויות לעיל. יובהר כי בתהליך קביעת משקלות המדד במועד הקובע, משקל המניות שעיקר פעילותן בתחומים המפורטים לעיל לא יפחת מ-75%.

טכנולוגיה לניתוח שפה טבעית (NLP) היא למעשה אלגוריתם ממוחשב ומתוחכם מאוד שתהליך העיבוד שלו דומה לאופן שבני אדם מתקשרים זה עם זה ולא רק טקסט שמתורגם לשפת מכונה. במילים אחרות, מדובר במחשב שמסוגל לבצע מטלות בתחום השפה, כדוגמת תמצות של טקסט ארוך מאוד, תיקון דקדוק או מטלות אחרות שהוגדרו בצורה מדויקת ל"מכונה". במקרה דנן, מדובר בטכנולוגיה שפותחה לצורך סיווג ענפי של חברות. השלב הראשון ביצירת מודל NLP הוא שלב האימון, אשר אפשר להקבילו ללימוד דקדוק לשוני אצל ילדים. השלב השני של המודל הינו יצירת דאטה בצורת טקסט על כל חברה וטעינתו למערכת. בשלב זה המערכת מבצעת ניתוח שפה טבעית בהתאם למודל ומותירה את החברות אשר המונח "אנרגיה ירוקה" ניתן כמענה לשאלה מה תחום הפעילות של החברה. בשלב אחרון מבצעת אינדקס תהליך בחינה נוסף לסיווג כל החברות שהתקבלו לגביהן תוצאת "אנרגיה ירוקה". תהליך זה כולל בחינה של גורם אנושי וזאת כדי לוודא שאכן תחומי הפעילות של החברות תואמים את ההגדרה "אנרגיה ירוקה". יובהר כי חברה שלא סווגה בתחום הפעילות של המדד על ידי טכנולוגיית AI לא תיכלל במדד.

אודות AI21 Labs - AI21 היא חברה המתמחה בפיתוח טכנולוגיות בינה מלאכותית. החברה הוקמה על ידי יואב שוהם פרופ' למדעי המחשב מסטנפורד, אורי גושן ומייסד מובילאיי פרופ' אמנון שעשועו. החברה מפתחת מודלים מקיפים לניתוח שפה טבעית (NLP). במסגרת זו, ניתן "לאמן" מודלים מותאמים לצרכים עסקיים כדוגמת סיווג פעילויות עסקיות, התמחויות ספציפיות, מיקוד גיאוגרפי ועוד. מעבדות ה-NLP של AI21 הן תוצר של שנים של תהליכי מחקר ופיתוח של חוקרי בינה מלאכותית מובילים בארץ ובח"ל. למידע נוסף: [www.ai21.com](http://www.ai21.com)

### מזהה המדד

סימול מדד: 6121.

## הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, תעודות מניה אמריקאיות (ADR).
  - ניירות הערך רשומים למסחר באחת מהבורסות במדינות הבאות: ארה"ב, קנדה, בריטניה, גרמניה, צרפת, הולנד, בלגיה, איטליה, ספרד, פורטוגל, יוון, אירלנד, אוסטריה, לוקסמבורג, שוויץ, שבדיה, דנמרק, נורבגיה, פינלנד, יפן, סין (הונג קונג בלבד), סינגפור, ישראל. היה ונייר ערך נסחר במקביל הן בבורסה בישראל והן בבורסות מחוץ לישראל, יכלול במדד נייר ערך אשר נסחר בבורסה בישראל.
  - ניירות הערך נקובים בדולר ארה"ב, דולר קנדי, לירה שטרלינג, אירו, פרנק שוויצרי, כתר שבדי, כתר דני, כתר נורבגי, ין יפני, דולר הונג קונג, דולר סינגפורי, שקל חדש.
  - מנפיקי ניירות הערך מסווגים על ידי טכנולוגיית AI כבעלי פעילות בתחומים הבאים:  
Renewable Energy-Production, Renewable Energy-Materials, Renewable Energy-Ecosystem.
  - שווי שוק ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-100 מיליון דולר ארה"ב.
  - התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-250,000 דולר ארה"ב.
  - ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-20.
  - סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד ובלבד שלכל הפחות 60% מכמות ניירות הערך במדד הן מניות שעיקר פעילותן בתחומים המפורטים לעיל.
- \* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 60.

## עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iNDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

## חישוב המדד

- תחילת פרסום: 08/07/2022.
- התחלת שערים היסטוריים: 31/12/2018.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת נטו (NTR).
- מטבע חישוב: דולר ארה"ב.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: 3%.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: משקלן המצרפי של כל המניות שעיקר פעילותן בתחומים המפורטים לעיל לא יפחת מ-75% ממשקל המדד.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: תיקון פקטור מגבלת משקל של ניירות ערך במדד בהתאם לפרמטרים הבאים: (1) השיעור המנורמל של הצמיחה ברווח השנתי של מנפיק נייר הערך ביחס

לצמיחה המשוקללת ברווח השנתי של כל מפיקי ניירות הערך הנכללים במדד - פקטור שבין 0.9 ל-1.1; (2) הציון המנורמל של דירוג ESG בקטגוריית "חוסן שרשרת אספקה" של מפיק נייר הערך ביחס לדירוג ה-ESG בקטגוריית "חוסן שרשרת אספקה" של כל מפיקי ניירות הערך הנכללים במדד - פקטור שבין 0.9 ל-1.1.

### **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? כן, המדד שואף לקיים יעד של אחריות סביבתית (Environment).
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? כן. בתנאי הסף של המדד קיימת דרישה כי רק חברות המתמחות בתחומי אנרגיה ירוקה יכללו במדד ופקטור מגבלת המשקל של ניירות ערך במדד מתוקנן בהתאם לדירוג ESG בקטגוריית "חוסן שרשרת אספקה" של מפיקי ניירות הערך.



### תמצית המדד

המדד כולל מניות של חברות גלובליות המתמחות בפיתוח טכנולוגיות בתחום אגירת אנרגיה.

המונח "אגירת אנרגיה" מתייחס לחברות המתמחות בתהליכים הקשורים לאגירת אנרגיה שמקורה בתהליכים טבעיים מתמשכים, שאינם מתכלים כתוצאה מרתימת האנרגיה האצורה בהם. בהתאם לכך, המדד מתמקד בחברות העוסקות בייצור ליתיום, בהטענת סוללות תעשייתיות, בפיתוח טכנולוגיות לאגירת אנרגיה ולהפקת אנרגיה מתאי דלק.

הכללת מניה במדד תיעשה על פי סיווג עורך המדד בהתאם לתחומי ההתמחויות הבאים של החברות הכלולות:

- **יצרני ליתיום** - חברות המתמחות בייצור ליתיום המשמש כחומר גלם עיקרי בתהליך ייצור סוללות חשמליות.
- **הטענת סוללות תעשייתיות** - חברות המתמחות בפיתוח טכנולוגיות וכלים ייעודיים לצורך הטענת סוללות לשימוש תעשייתי.

- **טכנולוגיות אגירת אנרגיה** - חברות המתמחות בפיתוח טכנולוגיות לאגירת אנרגיה.

- **טכנולוגיות תאי דלק** - חברות המתמחות בפיתוח טכנולוגיות להפקת אנרגיה מתאי דלק.

המניות אשר תיכללנה במדד הן של חברות אשר עורך המדד בחן אותן באופן ספציפי ומצא כי למעלה מ-25% מהכנסותיהן נובעות מהפעילויות המפורטות בתחומי ההתמחות המפורטים לעיל ו/או שהן בעלות נתח שוק שלא יפחת מ-5% באחת הפעילויות המפורטות בתחומי ההתמחות המפורטים לעיל.

אף על פי האמור לעיל, עיקר הפעילות של חברה בתחומים לעיל מוגדרת על ידי עורך המדד רק במידה ולפחות 50% מהכנסות המצרפיות של החברה תהיינה מהפעילויות לעיל. יובהר כי בתהליך קביעת משקלות המדד במועד הקובע, משקל המניות שעיקר פעילותן בתחומים המפורטים לעיל לא יפחת מ-75%.

### מזהה המדד

סימול מדד: 6125.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה, תעודות מניה אמריקאיות (ADR), תעודות מניה גלובליות (GDR).
- ניירות הערך רשומים למסחר באחת מהבורסות במדינות הבאות: ארה"ב, קנדה, בריטניה, גרמניה, צרפת, הולנד, בלגיה, איטליה, ספרד, פורטוגל, יוון, אירלנד, אוסטרליה, לוקסמבורג, שווייץ, שבדיה, דנמרק, נורבגיה, פינלנד, יפן, סין (הונג קונג בלבד), סינגפור, דרום קוריאה, טאיוואן, ישראל. היה ונייר ערך נסחר במקביל הן בבורסה בישראל והן בבורסה מחוץ לישראל, יכלל במדד נייר ערך אשר נסחר בבורסה בישראל.
- ניירות הערך נקובים בדולר ארה"ב, דולר קנדי, לירה שטרלינג, אירו, פרנק שווייצרי, כתר שבדי, כתר דני, כתר נורבגי, ין יפני, דולר הונג קונג, דולר סינגפור, וון קוריאני, דולר טאיוואני, שקל חדש.
- מנפיקי ניירות הערך הם בעלי פעילות משמעותית בתחום אגירת אנרגיה, כאשר לכל הפחות הפעילויות הבאות מהוות למעלה מ-25% מהכנסות החברה בדוח התקופתי האחרון ו/או החברה מחזיקה בנתח שוק שלא יפחת מ-5% באחת מבין הפעילויות הבאות על פי דיווחיה או על פי נתונים פומביים: יצרני ליתיום; הטענת סוללות תעשייתיות; טכנולוגיות אגירת אנרגיה; טכנולוגיות תאי דלק.
- שווי שוק ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-100 מיליון דולר ארה"ב.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-250,000 דולר ארה"ב.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-20.

- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד ובלבד שלכל הפחות 60% מכמות ניירות הערך במדד הן מניות שעיקר פעילותן בתחומים המפורטים לעיל.

\* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 40.

### **עדכונים במדד**

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iNDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

### **חישוב המדד**

- תחילת פרסום: 08/03/2021.
- התחלת שיערים היסטוריים: 31/12/2019.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת נטו (NTR).
- מטבע חישוב: דולר ארה"ב.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: בהתאם למפורט בפרק "תקרות משקל במדדי שווי שוק" להלן.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: משקלן המצרפי של כל המניות שעיקר פעילותן בתחומים המפורטים לעיל לא יפחת מ-75% ממשקל המדד.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: אין.

### **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

### תמצית המדד

המדד כולל מניות של חברות גלובליות המתמחות בתחומי תשתיות חיוניות על פי סיווג מערכת בינה מלאכותית (AI).

המדד מבוסס על טכנולוגיה שפותחה באמצעות ניתוח שפה טבעית (NLP) של חברת הבינה המלאכותית AI21 במטרה לאתר ולסווג מניות של חברות בהתאם לפעילויות עסקיות שהוגדרו על ידי עורך המדד. במדד זה נוצר מודל NLP ייעודי שמטרתו לענות על השאלה איזה חברות פועלות בתחום התשתיות החיוניות, אשר מורכב מהפעילויות הבאות:

- **תשתיות תקשורת (Communications Infrastructure)** - חברות המתמחות בשירותי תשתיות תקשורת, פריסת סיבים והקמת מגדלים סלולריים.
- **תשתיות מים (Water Infrastructure)** - חברות המתמחות בייצור, אחסון, טיפול, בדיקה, הפצה ומכירה של מים לשימושים ביתיים, תעשייתיים וציבוריים.
- **תשתיות חשמל ואנרגיה (Energy / Electricity Infrastructure)** - חברות המתמחות בהקמה של תשתיות, ייצור, הולכה ואחסון של חשמל ואנרגיה.
- **תשתיות הולכת גז ונפט (Gas & Oil Transportation Utility)** - חברות המתמחות בהקמת תשתיות הולכת גז ונפט כגון צינורות המוליכים אנרגיה (גז ונפט) ומתקנים לאחסון ואגירת אנרגיה.
- **תשתיות תחבורה (Transportation Infrastructure)** - חברות המתמחות בפיתוח הקמה ותפעול של תשתיות תחבורה כגון נמלי תעופה, נמלים ימיים, כבישים וגשרים.

קיום פעילות בתחומים הללו מוגדרת על ידי עורך המדד באמצעות עמידה בסף מינימלי של אחד מהפרמטרים הבאים: (1) לכל הפחות 40% הכנסות מצרפיות מתחומי הפעילות; (2) לכל הפחות 25% רווחיות גלומה מתחומי הפעילות; (3) לכל הפחות 5% נתח שוק בתחומי הפעילות; (4) לכל הפחות 3% השקעות מ"פ בתחומי הפעילות ביחס להכנסות החברה; (5) מיזוגים ורכישות בתחומי הפעילות מעל 10% משווי החברה בעת הרכישה/מיזוג ו/או רכישה/מיזוג בהיקף של 50 מיליון דולר ומעלה.

אף על פי האמור לעיל, עיקר הפעילות של חברה בתחומים לעיל מוגדרת על ידי עורך המדד רק במידה ולפחות 50% מההכנסות המצרפיות של החברה תהיינה מהפעילויות לעיל. יובהר כי בתהליך קביעת משקלות המדד במועד הקובע, משקל המניות שעיקר פעילותן בתחומים המפורטים לעיל לא יפחת מ-75%.

טכנולוגיה לניתוח שפה טבעית (NLP) היא למעשה אלגוריתם ממוחשב ומתוחכם מאוד שתהליך העיבוד שלו דומה לאופן שבני אדם מתקשרים זה עם זה ולא רק טקסט שמתורגם לשפת מכונה. במילים אחרות, מדובר במחשב שמסוגל לבצע מטלות בתחום השפה, כדוגמת תמצות של טקסט ארוך מאוד, תיקון דקדוק או מטלות אחרות שהוגדרו בצורה מדויקת ל"מכונה". במקרה דנן, מדובר בטכנולוגיה שפותחה לצורך סיווג ענפי של חברות. השלב הראשון ביצירת מודל NLP הוא שלב האימון, אשר אפשר להקבילו ללימוד דקדוק לשוני אצל ילדים. השלב השני של המודל הינו יצירת דאטה בצורת טקסט על כל חברה וטעינתו למערכת. בשלב זה המערכת מבצעת ניתוח שפה טבעית בהתאם למודל ומותירה את החברות אשר המונח "תשתיות חיוניות" ניתן כמענה לשאלה מה תחום הפעילות של החברה. בשלב אחרון מבצעת אינדקס תהליך בחינה נוסף לסיווג כל החברות שהתקבלו לגביהן תוצאת "תשתיות חיוניות". תהליך זה כולל בחינה של גורם אנושי וזאת כדי לוודא שאכן תחומי הפעילות של החברות תואמים את ההגדרה "תשתיות חיוניות". יובהר כי חברה שלא סווגה בתחום הפעילות של המדד על ידי טכנולוגיית AI לא תיכלל במדד.

אודות AI21 Labs - AI21 היא חברה המתמחה בפיתוח טכנולוגיות בינה מלאכותית. החברה הוקמה על ידי יואב שוהם פרופ' למדעי המחשב מסטנפורד, אורי גושן ומייסד מובילאיי פרופ' אמנון שעשוע. החברה מפתחת מודלים מקיפים לניתוח שפה טבעית (NLP). במסגרת זו, ניתן "לאמן" מודלים מותאמים לצרכים עסקיים כדוגמת סיווג

פעילויות עסקיות, התמחויות ספציפיות, מיקוד גיאוגרפי ועוד. מעבדות ה-NLP של AI21 הן תוצר של שנים של תהליכי מחקר ופיתוח של חוקרי בינה מלאכותית מובילים בארץ ובח"ל. למידע נוסף: [www.ai21.com](http://www.ai21.com)

## **מונה המדד**

סימול מדד: 6127.

## **הרכב ניירות הערך במדד**

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, תעודות מניה אמריקאיות (ADR).
- ניירות הערך רשומים למסחר באחת מהבורסות במדינות הבאות: ארה"ב, גרמניה, צרפת, הולנד, בלגיה, איטליה, ספרד, פורטוגל, יוון, אירלנד, אוסטרליה, לוקסמבורג, פינלנד.
- ניירות הערך נקובים בדולר ארה"ב, אירו.
- מנפיקי ניירות הערך מסווגים על ידי טכנולוגיית AI כבעלי פעילות בתחומים הבאים: תשתיות תקשורת (Communications Infrastructure), תשתיות מים (Water Infrastructure), תשתיות חשמל ואנרגיה (Energy / Electricity Infrastructure), תשתיות הולכת גז ונפט (Gas & Oil Transportation Utility), תשתיות תחבורה (Transportation Infrastructure).
- שווי שוק ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-100 מיליון דולר ארה"ב.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-250,000 דולר ארה"ב.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-20.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד ובלבד שלכל הפחות 60% מכמות ניירות הערך במדד הן מניות שעיקר פעילותן בתחומים המפורטים לעיל.

\* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 50.

## **עדכונים במדד**

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "INDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

## **חישוב המדד**

- תחילת פרסום: 13/02/2023.
- התחלת שערים היסטוריים: 31/12/2018.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת נטו (NTR).
- מטבע חישוב: דולר ארה"ב.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: 5%.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.

- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: משקלן המצרפי של כל המניות שעיקר פעילותן בתחומים המפורטים לעיל לא יפחת מ-75% ממשקל המדד ומשקלם המצרפי של כל ניירות הערך הנכללות בתחום מסוים שהוגדר במדד לא יעלה על 40% ממשקל המדד.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: תיקון פקטור מגבלת משקל של ניירות ערך במדד בהתאם לציון המנורמל של דירוג ESG כללי של מנפיק נייר הערך ביחס לדירוג ה-ESG הכללי של כל מנפיקי ניירות הערך הנכללים במדד - פקטור שבין 0.9 ל-1.1.

#### **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? כן, פקטור מגבלת המשקל של ניירות ערך במדד מתוקן בהתאם לדירוג ESG כללי של מנפיקי ניירות הערך.

### תמצית המדד

המדד כולל מניות של חברות שנסחרות בארה"ב ומתמחות בפיתוח תשתיות אזרחיות בארה"ב. המונח "תשתיות ובינוי" מתייחס לפעילויות הקשורות לפיתוח תשתיות אזרחיות ומורכב מחברות המתמחות בייצור חומרי גלם לתשתיות ובינוי, בייצור ואספקת ציוד לתחום התשתיות והבינוי וקבלני ביצוע לתחום. הכללת מניה במדד תיעשה על פי סיווג עורך המדד בהתאם לתחומי ההתמחויות הבאים של החברות הכלולות:

- **יצרני חומרי גלם לתשתיות ובינוי** - חברות המתמחות בכריית אלומיניום, ברזל ופלדה ומתכות מיוחדות לתחום התשתיות והבינוי וחברות המייצרות חומרי בניין.
- **יצרני וספקי ציוד תשתיות ובינוי** - חברות המתמחות בייצור ואספקת מכונות וכלי רכב כבדים, מכונות וציוד בנייה, מכונות וציוד חקלאי, מנועי קטר וחלקי חילוף לרכבות, מערכות חימום, אוורור ומיזוג אויר, מערכות מנוע והנעה, סטונאות מכונות וציוד תעשייתי, ציוד בנייה, ציוד משאבה ושאיבה ורכיבים וציוד חשמליים.
- **קבלני ביצוע תשתיות ובינוי** - חברות המתמחות בביצוע עבודות בניה והנדסה, סלילת כבישים וגשרים, שירותים סביבתיים וציוד, שירותי הדברה, שירותי קרקע ולוגיסטיקה ושירותי תמיכה עסקית. המניות אשר תיכללנה במדד הן של חברות אשר עורך המדד בחן אותן באופן ספציפי ומצא כי למעלה מ-25% מהכנסותיהן נובעות מהפעילויות המפורטות בתחומי ההתמחות המפורטים לעיל ו/או שהן בעלות נתח שוק שלא יפחת מ-5% באחת הפעילויות המפורטות בתחומי ההתמחות המפורטים לעיל. אף על פי האמור לעיל, עיקר הפעילות של חברה בתחומים לעיל מוגדרת על ידי עורך המדד רק במידה ולפחות 50% מהכנסות המצרפיות של החברה תהיינה מהפעילויות לעיל. יובהר כי בתהליך קביעת משקלות המדד במועד הקובע, משקל המניות שעיקר פעילותן בתחומים המפורטים לעיל לא יפחת מ-75%.

### מזהה המדד

סימול מדד: 6206.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות.
- ניירות הערך רשומים למסחר בבורסות בארה"ב.
- ניירות הערך נקובים בדולר ארה"ב.
- מנפיקי ניירות הערך הם בעלי פעילות משמעותית בתחום התשתיות והבינוי, כאשר לכל הפחות הפעילויות הבאות מהוות למעלה מ-25% מהכנסות החברה בדוח התקופתי האחרון ו/או החברה מחזיקה בנתח שוק שלא יפחת מ-5% באחת מבין הפעילויות הבאות על פי דיווחיה או על פי נתונים פומביים: יצרני חומרי גלם לתשתיות ובינוי, יצרני וספקי ציוד תשתיות ובינוי, קבלני ביצוע תשתיות ובינוי.
- שווי שוק ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-1 מיליארד דולר ארה"ב.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-250,000 דולר ארה"ב.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-20.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד ובלבד שלכל הפחות 60% מכמות ניירות הערך במדד הן מניות שעיקר פעילותן בתחומים המפורטים לעיל.

\* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 80.

## **עדכונים במדד**

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iINDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

## **חישוב המדד**

- תחילת פרסום: 18/06/2020.
- התחלת שערים היסטוריים: 29/12/2016.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת נטו (NTR).
- מטבע חישוב: דולר ארה"ב.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: בהתאם למפורט בפרק "תקרות משקל במדדי שווי שוק" להלן.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: משקלן המצרפי של כל המניות שעיקר פעילותן בתחומים המפורטים לעיל לא יפחת מ-75% ממשקל המדד.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: אין.

## **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

### תמצית המדד

המדד כולל מניות של חברות שנסחרות בארה"ב ומתמחות בשילוח אווירי או יבשתי באמצעות הובלה במשאיות וצי רכב.

המונח "שילוח אווירי ויבשתי" מתייחס לשליחת מוצרים מהיצרן/היבואן אל הצרכן וזאת באמצעות כלי טיס או הובלה יבשתית (משאיות וצי רכב ייעודי להובלות). תחום השילוח הרחב כולל גם חברות המובילות סחורות ומוצרים באמצעות רכבות ואוניות משא.

הכללת מניה במדד תיעשה על פי סיווג עורך המדד בהתאם לתחומי ההתמחויות הבאים של החברות הכלולות:

- **שילוח אווירי** - חברות המתמחות בהובלת סחורות ומוצרים בכלי טיס כגון מטוסים ורפנים.
  - **שילוח יבשתי** - חברות המתמחות בהובלת סחורות ומוצרים באמצעות משאיות וצי רכב ייעודי להובלות.
- המניות אשר תיכללנה במדד הן של חברות אשר עורך המדד בחן אותן באופן ספציפי ומצא כי למעלה מ-25% מהכנסותיהן נובעות מהפעילויות המפורטות בתחומי ההתמחות המפורטים לעיל ו/או שהן בעלות נתח שוק שלא יפחת מ-5% באחת הפעילויות המפורטות בתחומי ההתמחות המפורטים לעיל.
- אף על פי האמור לעיל, עיקר הפעילות של חברה בתחומים לעיל מוגדרת על ידי עורך המדד רק במידה ולפחות 50% מהכנסות המצרפיות של החברה תהיינה מהפעילויות לעיל. יובהר כי בתהליך קביעת משקלות המדד במועד הקובע, משקל המניות שעיקר פעילותן בתחומים המפורטים לעיל לא יפחת מ-75%.

### מזהה המדד

סימול מדד: 6209.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה, תעודות מניה אמריקאיות (ADR).
  - ניירות הערך רשומים למסחר בבורסות בארה"ב.
  - ניירות הערך נקובים בדולר ארה"ב.
  - מנפיקי ניירות הערך הם בעלי פעילות משמעותית בתחום השילוח האווירי והיבשתי, כאשר לכל הפחות הפעילויות הבאות מהוות למעלה מ-25% מהכנסות החברה בדוח התקופתי האחרון ו/או החברה מחזיקה בנתח שוק שלא יפחת מ-5% באחת מבין הפעילויות הבאות על פי דיווחיה או על פי נתונים פומביים: שילוח אווירי, שילוח יבשתי.
  - שווי שוק ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-100 מיליון דולר ארה"ב.
  - התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-250,000 דולר ארה"ב.
  - ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-20.
  - סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד ובלבד שלכל הפחות 60% מכמות ניירות הערך במדד הן מניות שעיקר פעילותן בתחומים המפורטים לעיל.
- \* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 40.

### עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.



- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iINDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

### **חישוב המדד**

- תחילת פרסום: 02/11/2020.
- התחלת שערים היסטוריים: 31/12/2015.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת נטו (NTR).
- מטבע חישוב: דולר ארה"ב.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: בהתאם למפורט בפרק "תקרות משקל במדדי שווי שוק" להלן.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: משקלן המצרפי של כל המניות שעיקר פעילותן בתחומים המפורטים לעיל לא יפחת מ-75% ממשקל המדד.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: אין.

### **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

### תמצית המדד

המדד כולל את 50 היצרניות הגלובליות בעלות סך ההכנסות הגבוה ביותר מבין המניות העומדות בתנאי המדד.

### מזהה המדד

סימול מדד: 6134.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה, תעודות מניה אמריקאיות (ADR), תעודות מניה גלובליות (GDR).
  - ניירות הערך רשומים למסחר באחת מהבורסות במדינות הבאות: ארה"ב, קנדה, בריטניה, גרמניה, צרפת, הולנד, בלגיה, איטליה, ספרד, פורטוגל, יוון, אירלנד, אוסטרליה, לוקסמבורג, שוויץ, שבדיה, דנמרק, נורבגיה, פינלנד, יפן, סין (הונג קונג בלבד), סינגפור, ישראל. היה ונייר ערך נסחר במקביל הן בבורסה בישראל והן בבורסות מחוץ לישראל, יכלול במדד נייר ערך אשר נסחר בבורסה בישראל.
  - ניירות הערך נקובים בדולר ארה"ב, דולר קנדי, לירה שטרלינג, אירו, פרנק שוויצרי, כתר שבדי, כתר דני, כתר נורבגי, ין יפני, דולר הונג קונג, דולר סינגפורי, שקל חדש.
  - מנפיקי ניירות הערך מסווגים באחד ממגזרי הפעילות הבאים: "ייצור תעשייתי", "ציוד אנרגיה", "יצרני תרופות", "מכשור רפואי", "חומרי בנייה", "חומרי גלם לתעשייה", "כימיקלים ומוצרי פלסטיק", "מוצרי אריזה, עץ ונייר", "מתכות ומינרלים", "שבבים", "ציוד טכנולוגי", "כלי רכב וחלקי חילוף", "מוצרי צריכה", או באחת מקבוצות ההתמחות הענפית הבאות: "חומרי בניין", "יצרני מזון", "יצרני משקאות", "מוצרים אישיים", בהתאם לסיווג iNDEX-Tree. אף על פי האמור לעיל, המדד עשוי לכלול גם מנפיקי ניירות ערך מסיווג ענפי שונה, ובלבד שמנפיקי ניירות הערך כאמור נבחנו באופן ספציפי על ידי עורך המדד ונמצאו כי למעלה מ-25% מהכנסותיהם נובעות מפעילויות "Manufacturers" ו/או שהן בעלות נתח שוק שלא יפחת מ-5% בתחום "Manufacturers". יובהר כי מספר מנפיקי ניירות הערך מסוג זה במדד לא יעלה על 10% ממספר מנפיקי ניירות הערך המירבי במדד במועד הקובע.
  - שווי שוק ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-100 מיליון דולר ארה"ב.
  - התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-250,000 דולר ארה"ב.
  - ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-20.
  - סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג הכנסות שנתיות של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד.
- \* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 50.

### עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iNDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

## **חישוב המדד**

- תחילת פרסום: 02/05/2021.
- התחלת שערים היסטוריים: 29/12/2016.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת נטו (NTR).
- מטבע חישוב: דולר ארה"ב.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: 5%.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: משקלן המצרפי של כל המניות הנכללות במגזרי הפעילות: "ייצור תעשייתי", "ציוד אנרגיה", "יצרני תרופות", "מכשור רפואי", "חומרי בנייה", "חומרי גלם לתעשייה", "כימיקלים ומוצרי פלסטיק", "מוצרי אריזה, עץ ונייר", "מתכות ומינרלים", "שבבים", "ציוד טכנולוגי", "כלי רכב וחלקי חילוף", "מוצרי צריכה", ובקבוצות ההתמחות הענפית: "חומרי בניין", "יצרני מזון", "יצרני משקאות", "מוצרים אישיים", לא יפחת מ-75% ממשקל המדד.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: אין.

## **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

### תמצית המדד

המדד כולל חברות גלובליות המתמחות בהובלה ושינוע של סחורות ומוצרים דרך נתיבי הים.

### מזהה המדד

סימול מדד: 6141.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה, תעודות מניה אמריקאיות (ADR), תעודות מניה גלובליות (GDR).
- ניירות הערך רשומים למסחר באחת מהבורסות במדינות הבאות: ארה"ב, קנדה, בריטניה, גרמניה, צרפת, הולנד, בלגיה, איטליה, ספרד, פורטוגל, יוון, אירלנד, אוסטרליה, לוקסמבורג, שווייץ, שבדיה, דנמרק, נורבגיה, פינלנד, יפן, סין (הונג קונג בלבד), סינגפור, ישראל. היה ונייר ערך נסחר במקביל הן בבורסה בישראל והן בבורסות מחוץ לישראל, יכלול במדד נייר ערך אשר נסחר בבורסה בישראל.
- ניירות הערך נקובים בדולר ארה"ב, דולר קנדי, לירה שטרלינג, אירו, פרנק שוויצרי, כתר שבדי, כתר דני, כתר נורבגי, ין יפני, דולר הונג קונג, דולר סינגפורי, שקל חדש.
- מנפיקי ניירות הערך מסווגים בקבוצת ההתמחות הענפית "שילוח ימי", בהתאם לסיווג iNDEX-Tree. אף על פי האמור לעיל, המדד עשוי לכלול גם מנפיקי ניירות ערך מסיווג ענפי שונה, ובלבד שמנפיקי ניירות הערך כאמור נבחנו באופן ספציפי על ידי עורך המדד ונמצאו כי למעלה מ-25% מהכנסותיהם נובעות מפעילויות "Marine Shipping" ו/או שהן בעלות נתח שוק שלא יפחת מ-5% בתחום "Marine Shipping". יובהר כי מספר מנפיקי ניירות הערך מסוג זה במדד לא יעלה על 10% ממספר מנפיקי ניירות הערך המירבי במדד במועד הקובע.
- שווי שוק ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-100 מיליון דולר ארה"ב.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-250,000 דולר ארה"ב.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-20.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.
- \* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 30.

### עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iNDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

## **חישוב המדד**

- תחילת פרסום: 15/10/2021.
- התחלת שיערים היסטוריים: 28/12/2017.
- ערך בסיס: 1,000.
- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת נטו (NTR).
- מטבע חישוב: דולר ארה"ב.
- מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
- תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: 5%.
- משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
- תקרת משקל ענפית במועד הקובע: משקלן המצרפי של כל המניות הנכללות בקבוצת ההתמחות הענפית "שילוח ימי" לא יפחת מ-75% ממשקל המדד.
- פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: אין.

## **שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**

- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
- האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

### תמצית המדד

המדד כולל מניות של חברות גלובליות המתמחות בכריית והפקת מתכות ומינרלים.

### מזהה המדד

סימול מדד: 6138.

### הרכב ניירות הערך במדד

להלן תנאי הסף הנדרשים מניירות הערך במועד הקובע לעדכון הרכב המדד על מנת להיכלל בו במועד עדכון המדד וזאת בנוסף לעמידה בתנאי הסף הכלליים שפורטו לעיל:

- ניירות הערך הם מסוג מניות רגילות, מניות בכורה, תעודות מניה אמריקאיות (ADR), תעודות מניה גלובליות (GDR).
- ניירות הערך רשומים למסחר באחת מהבורסות במדינות הבאות: ארה"ב, קנדה, בריטניה, גרמניה, צרפת, הולנד, בלגיה, איטליה, ספרד, פורטוגל, יוון, אירלנד, אוסטרליה, לוקסמבורג, שוויץ, שבדיה, דנמרק, נורבגיה, פינלנד, יפן, סין (הונג קונג בלבד), סינגפור, ישראל. היה ונייר ערך נסחר במקביל הן בבורסה בישראל והן בבורסות מחוץ לישראל, יכלול במדד נייר ערך אשר נסחר בבורסה בישראל.
- ניירות הערך נקובים בדולר ארה"ב, דולר קנדי, לירה שטרלינג, אירו, פרנק שוויצרי, כתר שבדי, כתר דני, כתר נורבגי, ין יפני, דולר הונג קונג, דולר סינגפורי, שקל חדש.
- מנפיקי ניירות הערך מסווגים במגזר פעילות "מתכות ומינרלים", בהתאם לסיווג iINDEX-Tree.
- שווי שוק ניירות הערך במועד הקובע אינו נמוך מ-100 מיליון דולר ארה"ב.
- התכ"מ של ניירות הערך במהלך 90 ימי המסחר שקדמו למועד הקובע לא תפחת מ-250,000 דולר ארה"ב.
- ועדת מדדים תגדיר את מספר מנפיקי ניירות הערך במדד\* ובלבד שלא יפחת מ-20.
- סינון ניירות הערך במועד הקובע יבוצע לפי דירוג שווי שוק ממוצע של כל ניירות הערך שיעמדו בכל תנאי הסף של המדד, כאשר יגרעו ממנו עד 25% ממספר ניירות הערך במדד במועד הקובע בעלי דירוג שווי שוק ממוצע הנמוך ביותר מבין אלה שנכללו במדד במועד הקובע ומנגד, יתווספו למדד ניירות ערך ששווי השוק הממוצע שלהם לא יפחת משיעור של 105% משווי השוק הממוצע של נייר הערך בעל דירוג שווי שוק הממוצע הגבוה ביותר מבין ניירות הערך שנכללו במדד במועד הקובע אולם על פי דירוג שווי שוק ממוצע כאמור אינו צפוי להיכלל ברשימת ניירות הערך בעדכון הקרוב.
- \* נכון למועד מסמך זה, ועדת מדדים הגדירה כי מספר מנפיקי ניירות הערך במועד הקובע לא יעלה על 40.

### עדכונים במדד

- תדירות ומועדי עדכון הרכב: שנתית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- תדירות ומועדי עדכון משקלות: רבעונית, בהתאם למועדים המפורטים ב"מועדי עדכון מדדי מניות גלובל" להלן.
- מסלול מהיר להוספת ניירות ערך: אין.
- החלפת נייר ערך שנגרע מהמדד: בעת גריעה של נייר ערך מהמדד במועד שאינו מועד עדכון הרכב המדד, לא יתווסף במקומו נייר ערך אחר למדד, עד לעדכון הרכב המדד הבא.
- עדכונים ייחודיים במדד: יטופלו בהתאם למפורט במסמך "iINDEX Calculations and Corporate Events Guide" או לחילופין, בהתאם להחלטה של ועדת המדדים.

### חישוב המדד

- תחילת פרסום: 05/07/2021.
- התחלת שערים היסטוריים: 31/12/2020.
- ערך בסיס: 1,000.

- אופן החישוב: מדד תשואה כוללת נטו (NTR).
  - מטבע חישוב: דולר ארה"ב.
  - מנגנון קביעת משקולות: מדד שווי שוק.
  - תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע: 5%.
  - משקל מינימלי לנייר ערך במועד הקובע: 0.1%.
  - תקרת משקל ענפית במועד הקובע: אין.
  - פרמטרים ייחודיים בעלי השפעה על קביעת משקולות: אין.
- שיקולי אחריות תאגידית (ESG) במדד**
- האם מתודולוגיית המדד שואפת לעמוד ביעדי ESG? אין.
  - האם מתודולוגיית המדד מתבססת על פרמטרים של ESG? אין.

## מועדי עדכון מניות ישראל

במידה ולא ויוחלט אחרת, הפרמטרים של מדדי מניות ישראל יבחנו ויעודכנו אחת לרבעון בהתאם למועדים שיפורטו להלן. ההרכב של כל מדד כאמור יבחן ויעודכן אחת לשנה לכל הפחות, כאשר לחלק מהמדדים יבוצע עדכון הרכב בתדירות גבוהה יותר, כפי שמפורט בהגדרות המדדים לעיל. עדכון הרכב שנתי במדדים יבוצע במועד המפורט להלן בחודש אוגוסט. אולם במדדים הנושאים בשם מדד של הבורסה בת"א ובמדדים אשר תדירות העדכון בהם היא חצי שנתית, עדכון הרכב במדדים יבוצע בהתאם למועדי העדכון של הבורסה בת"א.

במידה ולא ויוחלט אחרת לגבי עדכון מדד מסוים, השינויים בפועל יכנסו לתוקף בתום יום המסחר שיחול ביום חמישי הראשון של החודשים פברואר, מאי, אוגוסט ונובמבר וזאת בכפוף לכך שבאותו יום מתקיים מסחר בבורסה בישראל. על אף האמור לעיל, יובהר כי במידה ומועד עדכון מסוים אמור לחול ביום בו שעות המסחר בבורסה בישראל הן קצרות מהקבוע בלוח הזמנים למסחר במניות ובניירות ערך והמירים (בשל חול המועד או סיבה אחרת) או לחילופין, אמור לחול ביום בו לא מתקיים מסחר בבורסות חו"ל שניירות ערך במדדים כאמור רשומים למסחר בהן, יוקדם או ידחה עדכון המדד כאמור בהתאם להחלטת ועדת המדדים.

המועד הקובע לעדכוני מדד יחול בתום המסחר 21 ימי מסחר טרם מועד כניסת השינויים לתוקף.

## מועדי עדכון מניות גלובל

במידה ולא ויוחלט אחרת, הפרמטרים של מדדי מניות גלובל יבחנו ויעודכנו אחת לרבעון בהתאם למועדים שיפורטו להלן. ההרכב של כל מדד כאמור יבחן ויעודכן אחת לשנה לכל הפחות, כאשר לחלק מהמדדים יבוצע עדכון הרכב בתדירות גבוהה יותר, כפי שמפורט בהגדרות המדדים לעיל. עדכון הרכב שנתי במדדים יבוצע במועד המפורט להלן בחודש דצמבר ועדכון הרכב חצי שנתי במדדים יבוצע במועד המפורט להלן בחודשים יוני ודצמבר.

במידה ולא ויוחלט אחרת לגבי עדכון מדד מסוים, השינויים בפועל יכנסו לתוקף בתום יום המסחר שיחול ביום שישי השלישי של החודשים מרץ, יוני, ספטמבר ודצמבר. על אף האמור לעיל, יובהר כי במידה ומועד עדכון מסוים אמור לחול ביום בו לא מתקיים מסחר בבורסות שניירות ערך במדדים כאמור רשומים למסחר בהן, יוקדם או ידחה עדכון המדד כאמור בהתאם להחלטת ועדת המדדים.

המועד הקובע לעדכוני מדד יחול בתום המסחר 21 ימי מסחר טרם מועד כניסת השינויים לתוקף.



# משקל נייר ערך במדדים

## תקרות משקל במדדי שווי שוק

עבור כל מדד לעיל שנקבע עבורו כי תקרת משקל לנייר ערך במועד הקובע תהא בהתאם למפורט בפרק "תקרות משקל במדדי שווי שוק", תקרת המשקל כאמור תיקבע כמפורט להלן במועד הקובע לעדכון המדד בהתאם לכמות מנפיקי ניירות הערך העומדים בתנאי הסף של כל מדד ובלבד שהמשקל של מנפיקי ניירות ערך במדד לא יעלה על 23.5% במועד הקובע:

תקרת משקל למנפיקי ניירות ערך במדד*	כמות מנפיקי ניירות ערך במדד
23.5%	עד 10
20%	10-14
18%	15-19
16%	20-24
15%	25-29
14%	30-49
12.5%	50-99
10%	100-199
7.5%	200-399
5%	400 ומעלה

\* יובהר כי השיעורים לעיל הינם תקרת המשקל המירבית של מנפיקי ניירות ערך במדד וכי ועדת המדדים רשאית לקבוע תקרת משקל נמוכה יותר למנפיקי ניירות ערך במדד מסוים.

## חישוב משקל נייר ערך במדדים

משקל נייר ערך במדד מסוים יחושב על פי הנוסחה שלהלן:

$$W_i^t = \frac{Q_i^t \times IWF_i^t \times P_i^t \times F_X^t}{\sum_{i=1}^n (Q_i^t \times IWF_i^t \times P_i^t \times F_X^t)}$$

$W_i^t$  - משקל נייר ערך i במדד במועד t

n - מספר ניירות הערך במדד

$Q_i^t$  - כמות היחידות של נייר ערך i במועד t

$IWF_i^t$  - פקטור מגבלת המשקל של נייר ערך i במועד t

$P_i^t$  - שער נייר ערך i במועד t

$F_X^t$  - שער החליפין שבו נקוב נייר הערך במועד t. במקרה של נייר ערך נקוב בשער חליפין זהה לשער חליפין שבו מחושב המדד, השער שווה ל-"1".

## קביעת כמות היחידות של נייר ערך במדד

כמות היחידות של נייר ערך במדד מתבססת על ההון הרשום למסחר הידוע במועד הקובע וכל עוד לא יחול אירוע בנייר ערך, כמות היחידות שנקבעה עבור נייר ערך לעדכון מסוים לא צפויה להשתנות עד לעדכון הבא.

במקרים אחרים שבהם השתנה או צפוי להשתנות ההון הרשום למסחר של נייר ערך במדד, הטיפול באירוע יבוצע בהתאם למפורט במסמך "iNDEX Calculations and Corporate Events Guide".

## חישוב ועדכון פקטור מגבלת משקל של נייר ערך במדד

פקטור מגבלת משקל של נייר ערך במדד יחושב במועד הקובע בהתאם למפורט במסמך "iNDEX Calculations and Corporate Events Guide".

פקטור מגבלת משקל של נייר ערך במדד עשוי להתעדכן בין מועדי העדכון השונים במקרים מיוחדים כמפורט במסמך "iNDEX Calculations and Corporate Events Guide".

## חישוב שערי המדדים

שערי המדדים מחושבים על פי הנוסחה המפורטת להלן ובכפוף להתאמות בגין אירועי חברה ואירועי מדד ולמגבלות המפורטות במסמך "iNDEX Calculations and Corporate Events Guide":

$$I_{t,j} = \frac{\sum_{i=1}^n (Q_i^t \times IWF_i^t \times P_i^t \times FX^t)}{D}$$

$I_{t,j}$  - המדד ביום t בנקודת זמן j

n - מספר ניירות הערך במדד

$Q_i^t$  - כמות היחידות של נייר ערך i במועד t

$IWF_i^t$  - פקטור מגבלת המשקל של נייר ערך i במועד t

$P_i^t$  - שער נייר ערך i במועד t

$FX^t$  - שער החליפין שבו נקוב נייר הערך במועד t. במקרה של נייר ערך נקוב בשער חליפין זהה לשער חליפין שבו מחושב המדד, השער שווה ל-"1".

## אופן חישוב שערי המדדים

המדדים יחושבו בשיטת מדד תשואה כוללת ברוטו (GTR), בשיטת מדד תשואה כוללת נטו (NTR) או בשיטת מדד מחיר. אופן חישוב שערי המדד יעשה בהתאם לסוג המדד ולאופיו, וייתכן כי מדד מסוים יחושב ביותר משיטה אחת. היה ויחושב המדד בשיטת תשואה כוללת נטו (NTR), שיעורי המס של כל נייר ערך ינוכו בהתאם למדינת התושבות של מנפיק נייר הערך ויתבססו על הנתונים העדכניים המפורטים במסמך "שיעורי ניכוי מס במקור במדדי אינדקס".

## תדירות חישוב שערי המדדים

המדדים מחושבים בכל יום בו מתקיים מסחר בנייר אחד לפחות הנכלל במדד. רשימה של ימי החופשות בבורסה בת"א ניתן למצוא באתר [www.tase.co.il](http://www.tase.co.il). רשימה של ימי החופשות בבורסות חו"ל ניתן למצוא באתר: <https://www.sifma.org>.

## פרסום שערי המדדים

- א. שערי המדדים יפורסמו לפי חישוב המעוגל לספרה השנייה לאחר הנקודה העשרונית.
- ב. שערי הנעילה של המדדים יפורסמו לאחר סיום כל יום מסחר באתר עורך המדד.
- ג. שערים רציפים של המדדים יפורסמו בהתאם להחלטת עורך המדד.

## הבהרות

- א. הנתונים המשמשים לחישובי המדדים ועדכוני המדדים יתבססו על מידע פומבי ונתונים המתפרסמים על ידי בורסות ו/או מערכות מידע פיננסי.
- ב. בקרות מקרים אשר לא נקבעו לגביהם כללים במתודולוגיה או במסמכים הנלווים, ועדת המדדים תקבע כיצד לנהוג בנוגע לחישובי המדדים ועדכוני המדדים, בהתחשב בעקרונות המפורטים במתודולוגיה.
- ג. עדכון כמות ניירות ערך במדד ו/או כמות מירבית של ניירות ערך למנפיק במדד ו/או כמות מירבית של ניירות ערך לסקטור במדד ו/או כמות מירבית של ניירות ערך למדינה במדד יבוצע במקרים חריגים בלבד לצורך ניהול השגרתי של המדד. אף על פי האמור לעיל, במדדים שיגדיר עורך המדד, עדכון כאמור יבוצע רק במידה ויחולו שינויים כדוגמת שינויי רגולציה, שינויים ענפיים ומצבי שוק משתנים, העלולים לפגוע בחישוב התקין של המדד.
- ד. היה ובמועד מסוים, יתברר כי במדד מסוים צפויים להיכלל פחות מ-10 ניירות ערך, ועדת המדדים תיבחן את ההיצע הקיים המתאים לתנאי סף של המדד כאמור ותקבע האם להפסיק את חישובו, או לחלופין לבצע שינוי מתודולוגיה במסגרתו יוספו ניירות ערך המתאימים לפרופיל המדד. יובהר כי קיימים מדדים שמלכתחילה מכילים פחות מ-10 ניירות ערך והאמור לעיל לא יחול עליהם.
- ה. המדדים אינדקס ת"א-125 Quality, אינדקס ת"א-125 Smart Momentum ואינדקס ת"א-125 מומנטום ענפי פותחו, מחושבים ומפורסמים על ידי אינדקס ועל ידה בלבד. הבורסה בת"א אינה נושאת באחריות כלשהי למדדים אלה, ובכלל זה לקביעת הרכב המדדים, חישובם או פרסומם. הבורסה בת"א אינה נושאת באחריות כלשהי למדדים כאמור ו/או למוצרי מדד העוקבים אחר המדדים כאמור. אין ברשות שניתנה לאינדקס על ידי הבורסה בת"א להשתמש במדדי הבורסה, כהגדרתם להלן, או בנתוני המסחר של ניירות ערך הנסחרים בבורסה בת"א, משום המלצה לרכוש את מוצרי המדד המבוססים על המדדים כאמור, משום מתן חסות למוצרי מדד אלה או משום יצירת מצג כלשהו, כמפורש או במשתמע, בקשר עם כדאיות ההשקעה במוצרי מדד אלה. הבורסה בת"א הינה בעלת כל הזכויות במדד ת"א-125 ובשערי ניירות הערך המרכיבים את מדד הבורסה לעיל. הבורסה רשאית בכל עת וללא מתן הודעה מוקדמת, לשנות את דרך חישוב מדדי הבורסה ו/או דרך החישוב של נתוני המסחר של ניירות ערך הנסחרים בבורסה בת"א ו/או להפסיק לחשב את מדדי הבורסה ו/או נתוני המסחר של ניירות ערך הנסחרים בבורסה בת"א ו/או להפסיק לפרסמם.
- ו. אחת לשנה תבוצע בחינה מקיפה של מתודולוגיית המדדים אשר בסופה יפורסמו השינויים שיחולו במתודולוגיה.

## הפצת נתוני מדדים

- א. נתונים עדכניים על מדדי אינדקס, בהם שערי המדדים, רשימות ניירות הערך המרכיבים את המדדים ומשקלות ניירות הערך הנכללים במדדים ונתונים נוספים אודות מתודולוגיית המדדים ואופן חישובם, מפורסמים באתר אינדקס ([indx.co.il](http://indx.co.il)).
- ב. כמו כן, חלק מנתוני המדדים זמינים לצפייה גם במערכות מידע כדוגמת Bloomberg, Workspace ו-DSS של Refinitiv (חברת בת של הבורסה בלונדון), Sola ו-Eclipse של חברת המידע הגלובלית Markit, Super Bizportal ו-Terminal Bizportal מקבוצת קו מנחה, מגמה 2000 ו-Ace מקבוצת A-Online, גלובס TradeOne, FMR מקבוצת אפ.אמ.אר. מחשבים ותוכנה, BE של בי טכנולוגיה פיננסית.

מדדי אינדקס המופיעים במסמך זה נערכים ומחושבים על ידי אינדקס מחקר ופיתוח מדדים בע"מ (להלן ולעיל: "אינדקס"). כל הזכויות הנגזרות ממדדי אינדקס שייכות לאינדקס.

כל המידע המופיע במסמך זה מובא לצרכים אינפורמטיביים בלבד. המידע עלול לכלול אי דיוקים וטעויות וייתכן שחלו במידע המובא לעיל שינויים מאז פרסומו. אינדקס לא תהא אחראית בכל צורה שהיא לנזק או הפסד שיגרמו משימוש במידע המופיע במסמך זה, אם יגרמו, ואינה מתחייבת כי שימוש במידע זה עשוי ליצור רווחים בידי המשתמש. אין לראות במידע המופיע במסמך זה המלצה לביצוע פעולות השקעה ו/או תחליף לייעוץ/שיווק השקעות האמור להינתן באופן פרטני על פי צרכי המשקיע ו/או תחליף לשיקול דעתו העצמאי של הקורא.

אינדקס מעריכה כי הנוסחאות המופיעות במסמך זה עומדות בדרישות לחישוב מדדי ניירות ערך, אולם איננה אחראית לדיוק, לאמינות ולשלמות של נוסחאות אלו. אינדקס לא תהא אחראית בכל צורה שהיא לנזק או הפסד שיגרמו משימוש בנוסחאות אלו לצורך חישוב מדדי ניירות ערך עבור מכשירי השקעה ו/או שימוש בהם מצד משקיעים, משתמשים ולקוחות באשר הם. אף על פי שאינדקס עורכת ומחשבת את המדדים באמצעות מקורות מידע שלהערכתה הינם מהימנים, אין באפשרותה של אינדקס או של כל צד אחר להבטיח את הדיוק ו/או את השלמות של חישוב המדדים או המידע הנכלל בהם. אינדקס אינה אחראית כלפי כל משתמש או כלפי צד ג' כלשהו בגין נזקים ישירים, עקיפים, תוצאתיים או אחרים שיגרמו להם כתוצאה משימוש בנתוני המדדים או כתוצאה מטעות, ליקוי או שגיאה במדדים. אינדקס אינה מתחייבת להודיע בצורה כלשהי על טעות, ליקוי או שגיאה שנפלו במדדים.

מדדי ניירות ערך אינם מהווים מכשירי השקעה ולא ניתן להשקיע בהם באופן ישיר. אינדקס עוסקת בנייתו ובפיתוח, חישוב ועריכת מדדי ניירות ערך למגוון צרכי השקעה ואינה מנהלת, מאשרת, משוקקת או מקדמת מכשירי השקעה על המדדים שהיא עורכת ו/או מחשבת. השימוש במדדי אינדקס לצורך יצירת מכשירי השקעה מחייב התקשרות מראש עם אינדקס וקבלת זכות שימוש במדדים מאינדקס בכתב מראש. שמות המדדים הינם סימנים מסחריים של אינדקס אשר ניתנים לשימוש על ידי מנהלים של מכשירי השקעה במסגרת רישיון בתוקף. אין לבצע כל שימוש בסימנים המסחריים של אינדקס ללא אישור מראש ובכתב מאינדקס. לאינדקס אין כל מחויבות או אחריות, באופן מפורש או משתמע, כלפי כל משתמש ו/או כל צד שלישי בנוגע לכדאיות ההשקעה במוצרי השקעה בשוק ההון בכלל או במוצרי השקעה על מדדי אינדקס בפרט או ליכולת של מדדי אינדקס לעקוב אחר ביצועי שוק ההון.

משקיעים צריכים להיות מודעים לסיכונים הכרוכים בהסתמכות על מידע, נתונים ותהליכים כמותיים המשמשים לצורך פיתוח, עריכת וחישוב מדדי ניירות ערך. המידע והנתונים שבהם נעשה שימוש עלולים לכלול טעויות כתוצאה מהסתמכות על מקורות מידע שגויים/לא עדכניים ו/או שינויי שוק שחלו מרגע השימוש בהם ובנוסף, ייתכנו טעויות או אי דיוקים כתוצאה מכשלים טכניים בתהליך. בעוד אינדקס נוקטת בצעדים אקטיביים שמטרתם לאתר טעויות בנתונים וכשלים בתהליך כדי למזער את ההשפעה הפוטנציאלית שלהם על תוצאות המדדים, לא ניתן להבטיח לחלוטין שטעויות ושגיאות מסוג זה לא יתרחשו בפועל.

מסמך זה הינו רכוש של אינדקס. אין להעתיק, לשכפל, לצטט ו/או לפרסם מסמך זה, או כל חלק ממנו ללא קבלת אישור בכתב ומראש. כל הזכויות שמורות.