פסגות מוצרי מדדים בע"מ

רחוב אחד העם 14, תל-אביב
טלפון: 073-7968848; פקס: 03-6178471
("החברה")

19 במרץ 2015

לכבוד
רשות ניירות ערך
רחוב כנפי נשרים 22
ירושלים

לכבוד
הבורסה לניירות ערך בת"א בע"מ
רחוב אחוזת בית 2
תל-אביב

ג.א.נ.,

הנדון: **דו"ח מיידי בדבר המרה כפויה של סדרת תעודות בחסר (סדרה כ') כתוצאה מחציית ערך המדד**

בהתאם לסעיף 3.13.6 לתשקיף המדף של החברה מיום 25 בינואר 2007 (בסעיף זה: "**תשקיף המדף**"), החברה תבצע המרה כפויה של כל סדרת תעודות בחסר (סדרה כ') בכל מקרה בו ערך מדד ת"א 25 יגיע לשיעור של 80% ממחיר המימוש שנקבע, קרי בכל מקרה בו המדד יגיע לערך של 1,600 נקודות או יותר. היום, 19 במרץ 2015, במהלך המסחר, מדד ת"א 25 חצה את הערך האמור.

לפיכך, ניתנת בזאת הודעה כי החברה תבצע המרה כפויה של סדרת תעודות בחסר (סדרה כ') של החברה בהתאם ללוח הזמנים המפורט להלן:

	שלבי ההמרה		המועד	תאריך
1.	**"יום האירוע"**	היום בו ערך מדד ת"א 25, הגיע לשער מדד שבו תודיע החברה על ביצוע המרה כפויה מלאה של התעודות בחסר	יום X	19.3.2015
2.	**"יום הפרסום"**	יום ההודעה על קרות האירוע, על לוח הזמנים המדויק לביצוע ההמרה הכפויה ומועד קביעת ערך מדד ת"א 25 הקובע לפיו תבוצע ההמרה הכפויה	לא יאוחר מיום X+1 שהינו יום מסחר בארץ ולפני פתיחת המסחר	19.3.2015
	"יום המסחר האחרון"		X+1 שהינו יום מסחר	22.3.2015
3.	***"יום קביעת מדד הייחוס הקובע"***	יום ההודעה על מדד ת"א 25 הקובע והתמורה בהמרה הכפויה	X+2 ימי מסחר (עד השעה 14:00)	23.3.2015
4.	**"יום התשלום"** = **"היום הקובע"**	יום ההמרה הכפויה. מי שיחזיק ביום זה יהיה זכאי לקבל את תמורת ההמרה	X+5 ימי מסחר	26.3.2015

1. בהתאם, התמורה בהמרה הכפויה תחושב ביום 23 במרץ 2015 לפי מדד ת"א 25 הקובע (כהגדרתו בסעיף 3.2 לתשקיף), לפי הנוסחה המפורטת להלן:

$$(1-A)\times\left[1-\sum_{i=1}^{n}\frac{Ci}{365}\right]\times\frac{1600-Index_{Final}}{100}$$

הפרמטרים בנוסחה שלעיל הינם כהגדרתם בסעיף 3.12.12 לתשקיף.

2. בהתאם לסעיף 3.13.1.4, החברה לא תנכה מסכום ההמרה (כהגדרתו בסעיף 3.2 לתשקיף) עמלות המרה כלשהן.

3. ניכוי המס יבוצע על ידי חברי הבורסה בהתאם להוראות תקנות מס הכנסה (ניכוי מתמורה, מתשלום או מרווח הון במכירת נייר ערך או בעיסקה עתידית), התשס"ג - 2002.

להלן טבלה הכוללת פרטים מזהים אודות סדרת התעודות בחסר המוזכרת בדיווח זה:

סדרה	שם תעודה	מס' ני"ע	סוג תעודה	מדד יחס
כ'	פסגות סל חסר תא 25 (2000)	1104082	חסר	ת"א 25

בכבוד רב,

גיל שפירא, מנכ"ל החברה

<u>העתק</u>: משמרת - חברה לשירותי נאמנות בע"מ