

השקעות

209.4551

דוא"ל: ron.eichel@ymail.com

מרצה: ד"ר רון אייכל

שעת קבלה: בתיאום מראש.

שעות הרצאה: ימי ג' 16:00-19:00.

תקופת הקורס: 03/07/2018 – 24/07/2018.

דרישות קדם: 209.4550, 209.4535

תיאור הקורס:

מטרת הקורס היא להקנות לתלמידים ידע בסיסי תיאורטי ויישומי, בהכרת שוק ההון וניירות הערך העיקריים הנסחרים בו. החומר יכלול את מדידת התשואה והסיכון בהשקעות פיננסיות, הכרת המבנה המוסדי של שוק ההון, הפעילויות המתרחשות בו וניירות הערך הנסחרים בו, הבנת תהליך ההשקעה והערכת שווי ניירות הערך וכן, הכרת מדדי ביצוע והשוואה בין מוצרים.

בכל הקשור למסגרת המוסדית ולניירות הערך הנסחרים בו, הקורס יתייחס לשוק הישראלי וכן גם לשוק הפיננסי האמריקאי. ההתייחסות לשוק הפיננסי האמריקאי תהיה עקב היותו דוגמה לשוק פיננסי מפותח, וכן עקב חשיבותו הרבה כשוק הון בינלאומי מרכזי ומוביל.

דרישות הקורס:

- נוכחות חובה והשתתפות בהרצאות.
- קריאת החומר הנדרש.
- הגשת תרגילים.

נושאי הקורס:

מפגש	נושא	ספרות
1.	<ul style="list-style-type: none">• המוצרים, השחקנים הפעילים בשוק, המתווכים הפיננסיים• השוק הראשוני והמשני	לוי, פרק 3-1 לוי, פרק 11
2.	<ul style="list-style-type: none">• אפיקי החיסכון של הציבור• קרנות נאמנות, פנסיה וקופות גמל	לוי, פרק 14-18
3.	<ul style="list-style-type: none">• סקטור הבנקאות• הפיקוח על הבנקים	לוי, פרק 3 רוטנברג
4.	<ul style="list-style-type: none">• קרנות נאמנות, ביצועי קרנות (מדד שארפ, טריינור)• מבוא לניתוח ניירות ערך	לוי, פרק 12, 19, לוי, פרק 22

אופן חישוב הציון:

בחינה סופית – 90% (חומר מותר לבחינה: חומר פתוח + מחשבון)
תרגילים – 10% הגשה אישית – רק במערכת המודל.

תאריך הבחינה: יפורסם בהמשך.

רשימות קריאה:

1. חיים לוי משה סמט, מרשל סרנט, "הבורסה", מהדורה 2, הוצאת שוקן, 1999.
2. אדם רויטר, ספר האג"ת, הוצאת לומדון, 2005.
3. משה בן חורין, שוק ההון וניירות ערך, הוצאת צ'ריקובר, 1998.
4. דוד רוטנברג, ניהול בנקאי תקין, כתר הוצאה לאור, 2002.