

גידור סיכונים 209.4422

מרצה: ד"ר מחמוד קעדאן, רו"ח. דוא"ל - Mqadan@univ.haifa.ac.il

שעת קבלה: בתיאום מראש. משרד: חדר 607, בנין ג'יקובס, קומה 6

טלפון: 04-8249584. שעות הרצאה: ימי חמישי 15:00-18:00

תקופת הקורס: דצמבר 2020 עד פברואר 2021

דרישות קדם: השקעות (209.4120)

תיאור הקורס

הקורס מקנה לסטודנט כלים תיאורטיים ופרקטיים מעולם ההנדסה הפיננסית המודרנית. במהלך הקורס הסטודנט ילמד כיצד משמשים מכשירים, כמו אופציות, Forwards, Futures, Swaps, בעסקי גידור סיכונים, ובעיקר כיצד הם מתומחרים. הדגש בקורס הוא על שוקי האופציות, התנודתיות בשווקים הפיננסיים, וכן על גורמי הסיכון של מכשירים אלה.

דרישות הקורס

- נוכחות חובה (online) והשתתפות בהרצאות
- קריאת החומר הנדרש
- הגשת תרגילים

תוכנית הקורס

| פרקים | נשוא ההרצאה | שבוע |
|-------|---------------------------------------------|------|
| 1, 8 | מבוא לשוק הנגזרים | 1 |
| 9 | אסטרטגיות מסחר | 2 |
| 10 | חסמי מחירים לאופציות | 3 |
| 11 | עצים בינומיים | 4 |
| 13 | מודל בלאק ושולס | 5 |
| 15 | אופציות על מדדי מניות ומטבעות | 6 |
| 16 | חוזים עתידיים, חוזי החלף, ואופציות על חוזים | 7 |
| 17 | היווניות (the Greeks) | 8 |

ספרי לימוד

Hull, J. C., & Basu, S. (2016). Options, futures, and other derivatives. 9th Edition Pearson Education India.

ספרים בעברית

בן חורין משה. (2017). מכשירים פיננסיים נגזרים. הוצאת דיונון.
אלדור, רפי. (2010). אופציות וחוזים עתידיים. הוצאת רפי אלדור והבורסה לניירות ערך, 2010.

מבנה הציון הסופי

10% תרגילים

90% בחינה סופית