

אוניברסיטת בר-אילן
בית הספר למינהל עסקים

מבנה המיקרו של שוקי הון 70-838-01

ד"ר תמיר לוי

תוכן: קורס זה בוחן את התהליכים, התוצאות והמשמעויות של המסחר בניירות ערך, תוך התייחסות לסוגי הסוחרים בשוק, לאי-שכלולים בשוק ולמנגנוני מסחר ספציפיים, כגון: מסחר רציף, מגבלות מחירים וכו'.

הקורס יסקור מאמרים תיאורטיים ואמפיריים בתחום, ובהם:

- שיטות המסחר בבורסה לניירות ערך בתל אביב
- סוגי סוחרים
- ערך הנזילות
- מחירי ניירות הערך בטווח הארוך
- השפעת אינפורמציה לא סימטרית
- השפעת עלויות העסקה על המסחר
- ועוד

הציון: 90% בחינה

10% תרגיל

ביבליוגרפיה

- O'Hara, M., Market Microstructure Theory, 1995, Blackwell publishing.
- Harris, L., Trading and Exchanges: Market Microstructure for Practitioners (Financial Management Association Survey & Synthesis), 2003, Oxford University Press

הפניה לפרקים ספציפיים ולמאמרים רלבנטיים תתבצע במהלך הקורס.