



תאריך עדכון: יוני 2009

בחירת תיק השקעות 70-862

בית הספר למנהל עסקים

סוג הקורס: הרצאה ותרגיל

היקף שעות: 42

סמסטר: א

שנת לימודים: תש"ע

<http://faculty.biu.ac.il/~lauteb/lauterbach.htm>

אתר הקורס באינטרנט:

א. מטרת הקורס (מטרות על):

מטרת הקורס היא להקנות לסטודנט שליטה בסיסית במספר עקרונות מפתח בתחום ההשקעות בניירות ערך. עקרונות אלו יאפשרו לסטודנט ניתוח מפוקח יותר של מחירי ני"ע השונים ושל תיקי ההשקעות האפשריים.

ב. תוכן הקורס: (נושאים עיקריים)

1. סוגי ניירות הערך הנסחרים בבורסה ותהליך המסחר.
2. מושגי יסוד באג"ח.
3. ניתוח סיכוני אג"ח.
4. תיק השקעות: המקרה של שתי מניות.
5. תיק השקעות: המקרה של N מניות.
6. החזית היעילה וה – CAPM.
7. שימושים ב – CAPM.
8. הרחבות של ה – CAPM.
9. שיקולי מס ואינפלציה.
10. הטכניקה של בנית החזית היעילה.

ג. חובות הקורס:

דרישות קדם: יסודות המימון (או שווה ערך) בציון 76 לפחות.

מטלות: מדי שבוע יינתן תרגיל בית. התרגיל השבועי יופיע באתר שלי. הגשת התרגיל במועד חובה.

מרכיבי הציון הסופי: הציון יתבסס על בחינה סופית (90%), תרגילי בית והשתתפות בשיעורים.

ד. ביבליוגרפיה: (רשות)

למעוניינים בקריאה נוספת כדאי לעיין ב:

BODIE, KANE, MARCUS (2005) INVESTMENTS

משה בן חורין, שוק ההון וניירות הערך, הוצ' צריקובר.

שלמה סימנובסקי, הבורסה למתחילים, הוצ' מיטב.