
האוניברסיטה העברית בירושלים

סילבוס

אופציות ונכסים מותנים - 55709

תאריך עדכון אחרון 31-08-2021

נקודות זכות באוניברסיטה העברית: 3

תואר: מוסמך

היחידה האקדמית שאחראית על הקורס: מנהל עסקים

השנה הראשונה בתואר בה ניתן ללמוד את הקורס: 0

סמסטר: סמסטר א'

שפת ההוראה: עברית

קמפוס: הר הצופים

מורה אחראי על הקורס (רכז): ד"ר אורית מילוא

דוא"ל של המורה האחראי על הקורס: orit.milo@mail.huji.ac.il

שעות קבלה של רכז הקורס: חמישי, בתיאום מראש

מורי הקורס:

ד"ר אורית מילוא

תאור כללי של הקורס:

הבנה מעמיקה עם תחום הנכסים המותנים כאשר הדגש הוא על אופציות חוזים עתידיים.

מטרות הקורס:

הבנה מעמיקה של נכסים מותנים ותפקידם בניהול סיכונים וכן הכרת מודלים של תמחור אופציות ונכסים מותנים

תוצרי למידה

בסיומו של קורס זה, סטודנטים יהיו מסוגלים:

בסיום הקורס הסטודנטים ירכשו הבנה בסיסית בנגזרים (כלים פיננסיים מותנים), למה הם משמשים, איך לתמחר אותם באמצעות מודלים שונים, כגון: המודל הבינומי, בלאק שולס מרטון, וסימולציות מונטה קרלו.

דרישות נוכחות (%) :

80%

שיטת ההוראה בקורס: הרצאות מקוונות, תרגילים, מקרה בוחן

רשימת נושאים / תכנית הלימודים בקורס:

1. מבוא לאופציות
2. המודל הבינומי
3. מעבר מזמן בדיד לזמן רציף: מהבינומי לבלק שולס ומרטון (1-BS) והשוואתם
4. אסטרטגיות השקעה באופציות
5. תכונות האופציות
6. חוזי אקדמה וחוזים עתידיים (futures and forwards)
7. תנועה בראונית ומודל בלק-שולס-מרטון (2-BS)
8. גידור אופציות ו"היוונות"
9. תמחור אופציות על נכסים המשלמים דיבידנדים
10. נושאים מתקדמים ככל שהזמן יאפשר:
1. מבוא למגבלות מודל BS ו"החיוך" (Smile the)
2. מבוא למוצרים מובנים
3. מבוא לגידור סיכונים בחברות
4. אופציות ריאליות מבוא קצר

חומר חובה לקריאה:

מצגות

חומר לקריאה נוספת:

Hull J.C., 2012. *Options, Futures, and Other Derivatives*, 8th edition (NJ, US, Pearson)

Benninga S., 2008. *Financial Modeling*, 3rd edition (Cambridge, US, MIT Press)

מקורות נוספים, ספרים ומאמרים רשומים במצגות הקורס.

הערכת הקורס - הרכב הציון הסופי :

מבחן מסכם בכתב/בחינה בעל פה 95 %

הרצאה 0 %

השתתפות 0 %

הגשת עבודה 0 %

הגשת תרגילים 5 %

הגשת דו"חות 0 %

פרויקט מחקר 0 %

בחנים 0 %

אחר 0 %

מידע נוסף / הערות:

סטודנטים מוזמנים לפנות בשאלות ו/או הערות הנוגעות לשיעור במייל, בהפסקות של השיעור ובשעת הקבלה.

מבחן מסכם בקמפוס או מבחן מקוון