
האוניברסיטה העברית בירושלים

סילבוס

בחירת תיקי השקעות - 55847

תאריך עדכון אחרון 13-09-2016

נקודות זכות באוניברסיטה העברית: 3

תואר: מוסמך

היחידה האקדמית שאחראית על הקורס: מנהל עסקים

השנה הראשונה בתואר בה ניתן ללמוד את הקורס: 2017

סמסטר: סמסטר א'

שפת ההוראה: עברית

קמפוס: הר הצופים

מורה אחראי על הקורס (רכז): פרופ' משה (שיקי) לוי

דוא"ל של המורה האחראי על הקורס: mslm@huji.ac.il

שעות קבלה של רכז הקורס: לפי תאום

מורי הקורס:

פרופ משה לוי

תאור כללי של הקורס:
מושגי יסוד באי-ודאות, מחירי שיווי משקל של מניות, קריטריונים

של יעילות ובניית תיקי השקעות יעילים (הרכב אופטימלי של

השקעות במטבעות שונים), יישומים לבדיקת יעילות קרנות השקעה.

מטרות הקורס:
הענקת היסודות התיאורטיים והכלים הפרקטיים לקבלת החלטות השקעה ובניית תיקי השקעה.
מטרת הקורס להקנות ידע על תהליכי קבלת החלטות השקעה של פרטים, ולתרגם ידע זה לכלים מעשיים של בניית תיקי השקעות.

תוצרי למידה
בסיומו של קורס זה, סטודנטים יהיו מסוגלים:
להבין את תהליך קבלת ההחלטות בתנאי ודאות,

להכיר פרקטיקות של בניית תיקים, ולדעת לאמוד ביצועי השקעות.

דרישות נוכחות (%) :
0

שיטת ההוראה בקורס: הרצאה, ותרגילים שבועיים.

רשימת נושאים / תכנית הלימודים בקורס:
מכסום תוחלת תועלת

Prospect Theory

כללי Dominance Stochastic

אופטימיזציה של תיקים

אופק ההשקעה

חומר חובה לקריאה:

1. Levy and Sarnat, *Portfolio and Investment Selection: Theory and Practice*,
Prentice Hall, N.J. 1984.

2. Levy, *Stochastic Dominance*, Springer, 2006.
מאמרים:

Frost, P. A. and J. E. Savarino, 1988, "For better performance: Constrain portfolio weights", *Journal of Portfolio Management* 14, 29-34.

Kahneman, D., and Tversky, A. 1979. "Prospect Theory of Decisions under Risk,"
Econometrica, 47(2), 263-291.

Samuelson, Paul A., 1989, "The Judgment of Economic Science on Rational Portfolio Management: Indexing, Timing, and Long-Horizon Effects", *The Journal of Portfolio Management*, pp. 4-12.

Sharpe, William F., 1994, "The Sharpe Ratio", *Journal of Portfolio Management*,
21(1), pp. 49-58.

חומר לקריאה נוספת:

הערכת הקורס - הרכב הציון הסופי :

מבחן מסכם בכתב/בחינה בעל פה 100 %
הרצאה 0 %
השתתפות 0 %
גשת עבודה 0 %
גשת תרגילים 0 %
גשת דו"חות 0 %
פרויקט מחקר 0 %
בחנים 0 %
אחר 0 %

מידע נוסף / הערות:

חובת הגשה של 80% מהתרגילים.