
האוניברסיטה העברית בירושלים

סילבוס

אסטרטגיות השקעה חדשניות והשלכות על הדיווח החשבונאי - 55899

תאריך עדכון אחרון 09-12-2023

נקודות זכות באוניברסיטה העברית: 2

תואר: מוסמך

היחידה האקדמית שאחראית על הקורס: מנהל עסקים

השנה הראשונה בתואר בה ניתן ללמוד את הקורס: 0

סמסטר: סמסטר ב'

שפת ההוראה: עברית

קמפוס: הר הצופים

מורה אחראי על הקורס (רכז): מר אופיר סרדם

דוא"ל של המורה האחראי על הקורס: ofir.sardam@mail.huji.ac.il

שעות קבלה של רכז הקורס:

מורי הקורס:
ד"ר קרן בר-חוה,
מר אופיר סרדם

תאור כללי של הקורס:

הקורס בנוי משני חלקים:

החלק הראשון והמרכזי עוסק בנגזרים, מבוא ואסטרטגיות השקעה המשלבות אופציות ושילובן בתיק ההשקעות, טרנדים בקרב משקיעים פרטיים ומוסדיים כדוגמת השקעות ESG, מטבעות וירטואליים, ונושאים אקטואליים שיעלו במהלך הקורס. החלק השני מעניק היכרות עם סוגיות חשבונאיות אקטואליות והשלכות על הדיווח.

מטרות הקורס:

היכרות פיננסית וחשבונאית עם הטרנדים המובילים בשווקים הפיננסיים, השחקנים המרכזיים ואופן פעולתם.

הקניית ידע מעשי להשקעה באמצעות אסטרטגיות חדשניות ומגוונות בדגש על שילוב אופציות על מניות ומדדים מובילים.

תוצרי למידה

בסיומו של קורס זה, סטודנטים יהיו מסוגלים:

הסטודנטים יהיו מסוגלים ליישם אסטרטגיות השקעה חדשניות וגישות עדכניות לבחינת ההשלכות על הביצועים והדוחות הכספיים.

דרישות נוכחות (%) :

80

שיטת ההוראה בקורס: הרצאה

רשימת נושאים / תכנית הלימודים בקורס:

* אופציות (בארה"ב) - מאפייני המסחר, מודלים לעומת המציאות והשילוב בתיק ההשקעות

*ההשקעות אחראיות (ESG)

* עולם הקריפטו

* ניהול סיכונים בהשקעות - תרחישי קיצון, ברבורים שחורים ותנודתיות בשווקים

* מוצרים מובנים

* סוגיות חשבונאיות אקטואליות והשלכות על הדיווח.

חומר חובה לקריאה:

טאלב, נ' (2008), תעתועי האקראיות: הופעתו של הברבור השחור בשוקי ההון (ובחיים), תל אביב, ספרי עליית הגג וידיעות ספרים.

AGARWAL, V., MULLALLY, K. A., TANG, Y., & YANG, B. (2015). Mandatory Portfolio

-
- Disclosure, Stock Liquidity, and Mutual Fund Performance. The Journal of Finance, 70(6), 2733-2776.*
- John C. Hull (2016). Options, Futures, and other Derivatives, Prentice-hall, Engelwood Cliffs, New Jersey.*
- Maneet, A. (2012). The Alpha Masters: Unlocking the Genius of the World's Top Hedge Funds, John Wiley & Sons.*
- Natenberg, S. (2014). Option Volatility and Pricing: Advanced Trading Strategies and Techniques, 2nd Edition, McGraw-Hill Education.*
- Porter, Michael E. & Kramer Mark R. (2012). The Big Idea: Creating shared value, rethinking capitalism, Harvard Business Review.*

חומר לקריאה נוספת:

מרכיבי הציון הסופי :

הגשת עבודה מסכמת / פרויקט גמר / מטלת סיכום / מבחן בית / רפרט 60 %
מטלות הגשה במהלך הסמסטר: תרגילים / עבודות / מבדקים / דוחות / פורום / סימולציה ואחרות
20 %
נוכחות / השתתפות בסיוור 20 %

מידע נוסף / הערות: