

4/12/16

אוניברסיטת חיפה  
מחלקה למדעי המחשב

שם הקורס: אלגוריתמים

## תרגיל בית 2 – משחק השקעות

### הגדרות

- (1) משחק ההשקעות יערך במשך שלושה שבועות, בין התאריכים 19/12-6/1/17, בין הצוותים השונים של הקורס.
- (2) מטרת המשחק לצבור מקסימום רווחים תוך ביצוע השקעות/מסחר במניות בתקופת הזמן הנתונה. המסחר יתבצע במניות, ניתן להשקיע בכל המניות הנסחרות בשוק ההון האמריקאי. ניתן לבצע פעולות LONG ו SHORT.
- (3) כל צוות ינהל את המשחק בחשבון TradeStation אחד קבוע לאורך כל המשחק.
- (4) עומד לרשותכם חשבון התחלתי של \$1,000,000 לקניית מניות. יש לכם אפשרות להשתמש במינוף של \$1,000,000, ז"א כוח קניה של \$2,000,000. בכל נקודת זמן יש לנהל תיק לכל הפחות בשווי \$700,000 ומעלה.
- (5) יש לבצע פעולות מסחר על בסיס שבועי, לפחות 4 פוזיציות חדשות בכל שבוע.

### מטרות והערכה

- מטרת המשחק לצבור מקסימום רווחים תוך ביצוע השקעות/מסחר במניות בתקופת הזמן הנתונה. מעקב אחר תוצאות המשחק יתבצע ברמה השבועית, ויפורסם באתר הקורס.
- הערכת התרגיל תתבסס על המדרג הבא. צוות שיצליח להשיג תשואה:
- (1) מעל 15% מזכה בציון 100 בתרגיל + בonus 4 נקודות לציון הקורס.
  - (2) לחלופין אם אף צוות לא השיג את תשואה מעל 15%, הצוות שהשיג את התשואה המקסימלית (בתנאי שתהיה חיובית מעל 5%) בציון 100 בתרגיל + בonus 4 נקודות לציון הקורס.
  - (3) מעל 10% מזכה בציון 100 בתרגיל.
  - (4) מעל 7% ציון 95 בתרגיל.
  - (5) מעל 4% ציון 88 בתרגיל.

6) פחות מ 4% ציון 85 בתרגיל בתנאי שהצוות מגלה השתתפות פעילה לאורך כל התרגיל, ועומד בכל דרישות התרגיל.

## מעקב שבועי ודיווח

1) מעקב אחר התוצאות יתבצע ברמה השבועית. החישוב בדוח השבועי מתייחס למחירי הסגירה של השוק ביום ו'. הדוח יועלה לאתר הקורס, עד יום א', בכל השבועות של המשחק.

2) ניהול דוח מעקב שלכם, יתבצע באמצעות דו"ח אקסל בפורמט המצורף. בכל יום א' במהלך התרגיל יש לשלוח:

- a) את האקסל עם מצב הפוזיציות המעודכן נכון לסגירת השוק ליום ו' של השבוע הקודם.
- b) צילום מסך (לצרף בתוך קובץ האקסל ב- Worksheet המיועד לכך) של רשימת כל הפוזיציות עד לאותו יום מה - Orders Tab (כמפורט בסעיף 5).
- c) לצרף צילום מסך (לצרף בתוך קובץ האקסל ב- Worksheet המיועד לכך) של ה Balances Tab, כאשר ב Account Number נבחר מספר חשבון עם סיומת M.

## מעקב אחר הפוזיציות באמצעות Orders Tab <= Trade Manager

- לפתוח את ה Trade Manager על ה Orders Tab (למטה משמאל)

- קביעת שדות סינון בפנל העליון:

- בחירת מספר חשבון עם סיומת M
- Status – Filled Orders
- טווח התאריכים
- סיום: הפעלת הכפתור Retrieve Orders (למעלה מימין)

Entered	Filled/Canceled	Symbol	Spread	Type	Quantity	Qty Filled	Qty Left	Stop	Limit	Filled Price	Order Status	Route	Duration	Gr...
11/19/15 04:44:09 PM	11/19/15 04:44:09 PM	EBAY		Buy	500	500	0		Market	28.86	Filled	Intelligent	Day	
11/19/15 04:45:08 PM	11/19/15 05:20:06 PM	TEVA		Buy	100	100	0		61.30	61.30	Filled	Intelligent	Day	
11/19/15 04:46:09 PM	11/19/15 05:20:06 PM	TEVA		Buy	100	100	0		61.30	61.30	Filled	Intelligent	Day	
11/19/15 04:49:04 PM	11/19/15 04:49:04 PM	BABA		Buy	200	200	0		Market	78.21	Filled	Intelligent	Day	
11/19/15 04:49:26 PM	11/19/15 04:49:26 PM	WLL		Sell Short	100	100	0		Market	17.08	Filled	Intelligent	Day	
11/19/15 04:54:15 PM	11/19/15 04:54:15 PM	WDC		Sell Short	100	100	0		Market	63.72	Filled	Intelligent	Day	
11/19/15 09:08:05 PM	11/19/15 09:08:06 PM	BABA		Sell	200	200	0		Market	78.29	Filled	Intelligent	Day	
11/19/15 09:11:15 PM	11/19/15 09:16:46 PM	FB		Sell Short	200	200	0		106.20	106.20	Filled	Intelligent	Day	
11/19/15 09:13:53 PM	11/19/15 09:13:56 PM	FB		Sell Short	100	100	0		106.07	106.07	Filled	Intelligent	Day	
11/19/15 09:16:16 PM	11/19/15 10:14:10 PM	SPY		Buy	100	100	0		208.40	208.40	Filled	Intelligent	Day	
11/19/15 09:18:03 PM	11/19/15 09:18:03 PM	SPY		Buy	100	100	0		Market	208.57	Filled	Intelligent	Day	

## מעקב אחר יתרת חשבון ורווח כולל מתוך TradeManager

- לפתוח את ה Trade Manager על ה- Balances Tab (למטה מימין)

- שדות סינון בפנל העליון: ב Account Number בחירת מספר חשבון עם סיומת M ( מניות).

שדות: Real-Time Account Net Worth נותן לכם את שווי החשבון הנוכחי.