

University of Haifa Dept. of Computer Science



4/12/16

אוניברסיטת חיפה מחלקה למדעי המחשב

שם הקורס: אלגוטריידינג

תרגיל בית 2 – משחק השקעות

הגדרות

- 1) משחק ההשקעות יערך במשך שלושה שבועות, בין התאריכים <u>19/12-6/1/17,</u> בין הצוותים השונים של ההורס.
- 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 לקנית 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.

<u>מטרות והערכה</u>

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 + בונוס 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 + בונוס 4 נקודות לציון הקורס.
 - . מעל 10% מזכה בציון 100 בתרגיל (3
 - .4) מעל 7% ציון 95 בתרגיל (4
 - .5) מעל 4% ציון 88 בתרגיל (5

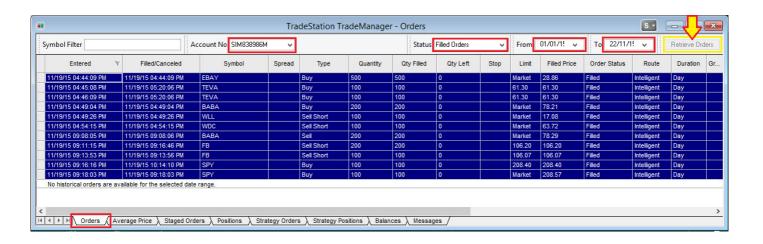
6) פחות מ 4% ציון 85 בתרגיל בתנאי שהצוות מגלה השתתפות פעילה לאורך כל התרגיל, ועומד בכל דרישות התרגיל.

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

Orders Tab <= Trade Manager מעקב אחר הפוזיציות באמצעות

- למטה משמאל) Orders Tab על ה Trade Manager לפתוח את ה
 - קביעת שדות סינון בפנל העליון:
 - י בחירת מספר חשבון עם סיומת M
 - Status Filled Orders
 - טווח התאריכים ■
 - oיום: הפעלת הכפתור Retrieve Orders (למעלה מימין) •



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.