

A photograph of several horses in a grassy field during sunset. The sun is low on the horizon, creating a strong golden glow and silhouetting the horses. One horse is in the foreground, facing away from the camera. Another is in the middle ground, also facing away. A third horse is in the background, facing the camera. The text 'HERD BEHAVIOR' is overlaid in large white letters.

HERD BEHAVIOR

פרויקט גמר – מספר 122

התנהגות עדר בשווקים פיננסיים

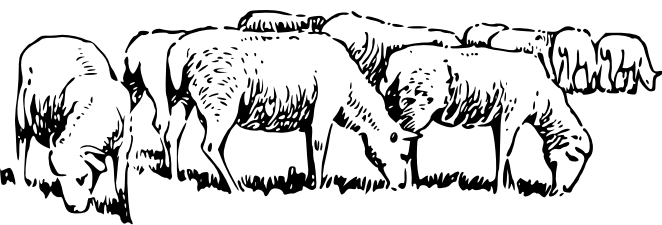
Herd Behavior on financial markets

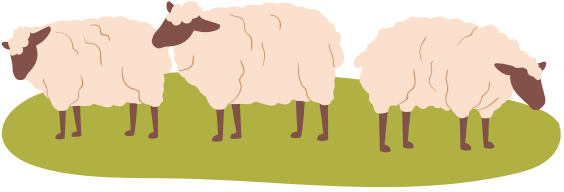
צוות הפרויקט: ענבל אפשטיין, יונתן גולן
הנחיה אקדמית: ד"ר מורן קורן

קבוצת סמינר מס': 10

מנחה הסמינר: עומר לב

מפגש מס': 1, 25-11-2024





פרויקט גמר – מספר 122

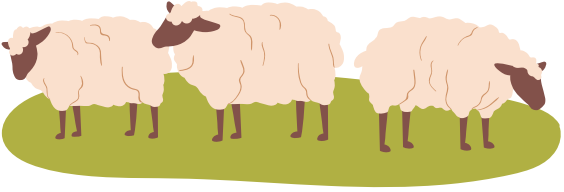
התנהגות עדר בשווקים פיננסיים

Herd Behavior on financial markets

תיאור כללי

הפרויקט עוסק בהשפעת תופעת העדר בשווקים פיננסיים ובוחן אם ניתן להשתמש בה לחיזוי מחירי מניות עתידיים

המחקר יעמיק בתופעות הפסיכולוגיות שמובילות לתופעה, כיצד היא משפיעה על החלטות השקעה, ואילו מדדים ניתן לגזור מנתונים היסטוריים לניתוח ולחיזוי תופעות אלו.



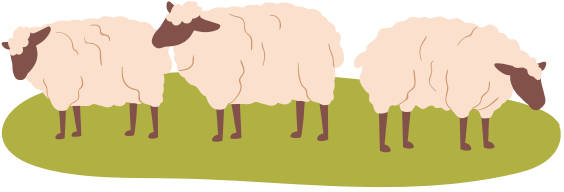
פרויקט גמר – מספר 122

התנהגות עדר בשווקים פיננסיים

Herd Behavior on financial markets

מוטיבציה

המוטיבציה המרכזית של הפרויקט היא להבין לעומק כיצד התנהגות המשקיעים משפיעה על תנודות השוק ומהם הגורמים הפסיכולוגיים שמניעים החלטות השקעה. במילים אחרות, לקשר את המחירים בשוק לתופעת העדר. באמצעות ניתוח תופעות אלו, ניתן למנף את ההבנה לפיתוח כלים משופרים לחיזוי מגמות בשוק ולתרום לקבלת החלטות פיננסיות מושכלות יותר עבור משקיעים וגופים פיננסיים כאחד.



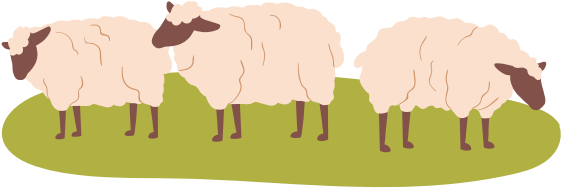
פרויקט גמר – מספר 122

התנהגות עדר בשווקים פיננסיים

Herd Behavior on financial markets

הקשר לנושאים הנלמדים

הנושא מתאים לפרויקט גמר בלימודי הנדסת תעשייה וניהול שכן הוא משלב היבטים פסיכולוגיים ועקרונות רציונליים שנלמדו בקורסים כמו "מבוא לקבלת החלטות". ניתן לשלב בו היבט תכנותי עם סוכנים רציונליים וחיזוי, מה שמחבר אותו לעולמות למידת מכונה. הפרויקט משלב עקרונות כלכלה התנהגותית, חקר ביצועים וניתוח נתונים, עם בסיס שניתן "מהקורסים" ניתוח נתונים פיננסיים ו"מבוא ללמידת מכונה".



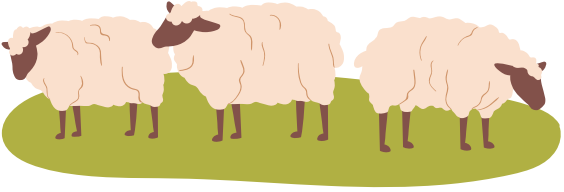
פרויקט גמר – מספר 122

התנהגות עדר בשווקים פיננסיים

Herd Behavior on financial markets

התקדמות

עד כה קיימנו מפגש עם מורן המנחה על מנת לחדד את הכיוון של הפרויקט, וקיבלנו ממנו מספר מאמרים מומלצים לקריאה. בתחום.אנו נמצאים בשלב איסוף חומרים לסקר הספרות בשלב הבא, אנו מתכננים להרחיב את איסוף המאמרים, לקרוא, לסכם ולהעמיק בהם, כדי להכיר טוב יותר את עולם התוכן ולגבש תובנות ורעיונות ליישום בשלב ב' של הפרויקט. בנוסף, נתחיל לגבש את מבנה סקר הספרות ולשלב בו תובנות מרכזיות מתוך המאמרים שנקרא.



פרויקט גמר – מספר 122

התנהגות עדר בשווקים פיננסיים

Herd Behavior on financial markets

הערכת סיכונים ונקודות אי וודאות

בשלב זה, יש לנו מספר שאלות פתוחות שעדיין מצריכות הבהרה, כמו הגדרת שאלת המחקר המדויקת שעליה נרצה לענות שתשפיע על כל תהליך ביצוע הפרויקט. עם זאת, איננו צופים קשיים משמעותיים שיערערו את התקדמות הפרויקט או את יציבותו.

סיכונים נוספים כוללים את היכולת להשיג גישה למאגרי נתונים רלוונטיים, כמו גם את איכות, מורכבות ועדכניות הנתונים שבהם נעשה שימוש. יש לבחון כיצד המודלים שנבחר יתמודדו עם מגבלות אפשריות בנתונים, כגון נתונים חסרים או רעש סטטיסטי, והאם יצליחו להפיק תוצאות מדויקות ואמינות.