ניתוח ניירות ערך – תרגיל תיק כיתה

### פרופסור בני לאוטרבך

בקובץ שבאתר הקורס נתונים מחירי המניות שבחרתם לתיק ומדד ת"א 100

##### משימות

1. חשב את התשואות היומיות של כל אחת מהמניות שבתיק ושל מדד ת"א 100. כמו-כן, בנה תיק שווה משקלות של המניות וחשב את תשואותיו היומיות.
2. אמוד את תוחלת התשואה ושונות התשואה של כל אחת מהמניות ושל התיק.
3. מהי תוחלת התשואה הממוצעת של המניות ? כיצד היא שונה מתוחלת תשואת התיק ?
4. מהי שונות התשואה הממוצעת של המניות ? כיצד היא שונה משונות תשואת התיק ?
5. מסקנה ? !
6. התאם את מודל השוק לכל מניה ולתיק שווה המשקלות שלנו.
7. בממוצע איזה % משונות התשואה היומית של המניה מוסבר ע"י השוק (שונות שיטתית) ואיזה % מוסבר ע"י חדשות ספציפיות לחברה (שונות בלתי שיטתית) ?
8. איזה % משונות התשואה היומית של התיק שלנו מוסבר ע"י השוק ?
9. מסקנה ? !
10. שער הריבית חסרת הסיכון ב- 7/11/2013 (מועד יצירת התיק) הוא 0.00004 ליום. הערך את ביצוע התיק.
11. חשב את מדד ג'נסן (בשיטת הרגרסיה)
12. חשב את מדד שארפ. והשוה אותו לשארפ של השוק.
13. מסקנה ? !
14. עבור כל אחת מהמניות הוספנו לכם נתונים אודות סך מאזן ושווי שוק מחולק בשווי ספר של הון עצמי.
15. הרץ רגרסיה של תוחלת תשואת המניה על הגודל - (סך מאזן)Ln.
16. הרץ רגרסיה של תוחלת תשואת המניה על מכפיל ההון (שווי שוק מחולק בשווי ספר).
17. מסקנה ? !