

מעבדה לניתוח נתונים פיננסיים 142.1.0123

נקודות זכות: 2
סמסטר: א'

מרצה: יגאל וינברגר yigalw@bgu.ac.il
מתרגלות: יונתן וולוך yonathan.wolloch@gmail.com
לירון עמור amorl@post.bgu.ac.il
(מדעי המחשב) (כלכלה)

זמני מפגשים: מפגש שבועי החל מה 23.11.22 / 2.5 שעות / ימי שלישי ב 17:15 / כיתה: TBA

תיאור הקורס:

המעבדה תתמקד בניתוח נתונים פיננסיים מהאספקט התיכנותי והכלכלי. נלמד איך לנתח דוחות פיננסיים, איך לעבד נתוני מסחר מהבורסה ואיך לבדוק אסטרטגיות מסחר אלגוריתמיות על נתוני העבר לטובת חישוב האינדיקטורים הרלוונטיים.

The lab will focus on the analysis of financial data from its economic and programming aspects. We will learn how to analyze financial reports, work with data from the stock market, and test algorithmic trading strategies on historical data to calculate different indicators.

דרישות הקורס

1. הגשת 2 תרגילים
2. נוכחות במפגשים

מבנה ציון

משימה	אחוז מהציון הסופי
השתתפות	10%
תרגיל 1	30%
תרגיל מסכם	60%

נושאי הקורס:

מפגש	תוכן
1	מבוא
2	קריאת נתונים מהבורסה בסיסית - מידע יומי
3	ניתוח נתוני דוח רבעוני
4	אלגוריתם בסיסי - בחירת תיק מניות
5	Backtesting
6	אלגוריתם מבוסס אינדיקטורים
7	המשך אלגוריתם מבוסס אינדיקטורים
8	סקירת תחום למידת מכונה ופיתוח אלגוריתמים