

דויד מור – מנהל תיקים וסוחר אג"ח ואופציות

השכלה

- בעל רישיון מנהל תיקים בישראל מהרשות לניירות ערך
- בעל תואר שני (EMBA) במנהל עסקים (עם התמחות במימון, בנקאות, שוק ההון והנדסה פיננסית) מהאוניברסיטה העברית
- הכשרה מקצועית בניהול סיכונים פיננסיים (FRM®) מאוניברסיטת אריאל בשומרון (250 שעות)
- הכשרה מקצועית במסחר באופציות וחוזים עתידיים מברק קפיטל

ניסיון מקצועי

- דויד מכיר על בוריים הן את מבנה שוק ההון בישראל והן את המדדים השונים המסכמים את הפעילות בשוק ההון.
- לדויד היכרות קרובה עם הנכסים והמכשירים הפיננסיים השונים, שיטות המסחר, שיטות החישוב של מחירי המכשירים הפיננסיים ומשמעות הפרמטרים המתפרסמים אודותם.
- לדויד ידע ניכר בשיטות השונות להערכת חברות ולהערכת אג"ח ובשיטות ניתוח של הסיכונים הכרוכים בהשקעה באג"ח ממשלתיות ובאג"ח קונצרניות, תוך שילובם בתיק ההשקעות.
- לדויד הבנה עמוקה ושליטה ברמה גבוהה בשימוש במכשירים פיננסיים ובדרכי החישוב של הסיכונים הכרוכים בהשקעה במכשירים הפיננסיים.
- לדויד ניסיון אינטנסיבי ביישום הידע והכלים שרכש בתחומי ניתוח ניירות הערך, תמחור המכשירים הפיננסיים וניהול תיקי ההשקעות ובביצוע אינטגרציה של הנושאים הסוגיות הלכה למעשה.
- לדויד ניסיון עשיר בבניית תיקי השקעות המותאמים לצורכי לקוחות והנחיותיהם כמו גם בניהולם באופן שוטף.
- לדויד ניסיון רב שנים בבניית תיקי השקעות שהרכבם וניהולם מתבסס על האיזון הנדרש בין הנכסים הפיננסיים והתאמתם לתנאים משתנים ולהתפתחויות בכלכלת ישראל והעולם.
- לדויד ניסיון נרחב בביצוע התאמות לניירות הערך הנבחרים על פי שינויי המחירים היחסיים של הנכסים הפיננסיים ועל פי הערכות מקצועיות של חברות שניירות הערך שלהן נסחרים בשוק.



davidmoore.65@gmail.com

למעלה מעשרים שנות ניסיון בתחומי המימון, ניהול הסיכונים, התמחור והמסחר באופציות וניהול ההשקעות



למר **דויד מור** למעלה מעשרים שנות ניסיון בתחומי המימון, ניהול הסיכונים, התמחר והמסחר באופציות וניהול ההשקעות

להלן תמצית נסיונו של מר **דויד מור** בתחומי המימון, ניהול הסיכונים, התמחר והמסחר באופציות וניהול ההשקעות:

מכשירים הפיננסיים: חוזים עתידיים ועסקאות Swap, נוהלי העבודה במכשירים פיננסיים בישראל ומערכת הבטחות של הבורסה וניהולה.

שימושים במכשירים פיננסיים: בניית אסטרטגיות שונות (אסטרטגיות עירומות, אסטרטגיות קומבינציה – אוקף ושוקת, אסטרטגיות מרווח ופרפר, אסטרטגית Box ושימוש בחוזים סינטטיים) והתאמתן לתנאי השוק וכן גידור סיכונים (Hedging).

תימחר אופציות: הקשר בין מחיר אופציה call ומחיר אופציה put, תכונות מחירי אופציות, גבולות מחירי אופציות, המודל הנאיבי, המודל הבינומי, Black and Scholes, רגישות מחיר האופציה לשינוי בפרמטרים ("היווניות"), הערכת כתבי אופציה והערכת מחירי ניירות ערך המונפקים על ידי חברות בעזרת מודלים להערכת אופציות.

ניהול תיקים: הגדרת צורכי הלקוח, קביעת רמת הסיכון בה ינוהל תיק הלקוח, בניית תיק השקעות הלכה למעשה, ניהולו השוטף של תיק ההשקעות בכל ההיבטים, יכולת תגובה וניתוח סיטואציות ותסריטים אפשריים בכלכלת ישראל ובשוק ההון.

ניהול סיכונים: VaR אנליטי, VaR היסטורי, VaR מונטה-קרלו, Backtesting, מבחני קיצון, עתות קיצון, שבירת קורלציות, נזילות, אפקט דומינו, מתודולוגיות סטנדרטיות (Expected Shortfall VaR, EVT, Crash Metrics), הגישה המשולבת) וניתוח תרחישים, יישומי ניהול סיכונים באקסל.

- **מכשירי השקעה בישראל והמיסוי החל עליהם:** קרנות נאמנות, ניירות ערך, תכניות חיסכון, קופות גמל, מוצרים מובנים, מטבע חוץ, תעודות סל והכרה של שוק הסחורות.
- **רישום למסחר ושיטות מסחר:** רישום ניירות ערך למסחר, שיטות מסחר בבורסה בישראל ובבורסות עיקריות בעולם, ניסיון רב עם גליון שערים ומדדי ניירות ערך בבורסה בישראל ובבורסות עיקריות בעולם, מכירות בחסר, חברות לרישומים, מסלקת הבורסה, מסלקת מעו"ף, השתתפות באסיפות כלליות ויפויי כוח (proxy).
- **גורמים המשפיעים על שווי ניירות ערך:** השלכות מיקרו והשלכות מאקרו.
- **תיאום שערים:** דיבידנד וריבית, מניות הטבה, זכויות והערכת חבילה בהנפקה.
- **שיטות שונות להערכת חברות:** ערך נכסי, שווי שוק, מכפיל ומדדי סיכון.
- **המבנה העתי של שערי הריבית**
- **הערכת אג"ח:** סוגי אג"ח ממשלתיות ואחרות ודרכי הנפקתן, קריטריונים להערכת אג"ח (לרבות תשואות, מיסוי, Duration, מינוף ובטוחות), מדידת סיכון (שיטות הרייטינג) וניתוח אג"ח להמרה.
- **תשקיף:** הבנה וניתוח כולל הערכת שווי