

Лычагин М. В. Финансовая экономика Курс лекций для магистрантов
учеб пособие для вузов — Новосибирск Издательство СО РАН 2005 — 344 с

Предлагаемый курс лекций разработан в соответствии с программой дисциплины "Финансовая экономика" для подготовки магистров по циклу "Общие гуманитарные и социально-экономические дисциплины" государственных образовательных стандартов высшего профессионального образования второго поколения

Курс лекций знакомит с предпосылками формирования и современным состоянием совокупности теоретических и прикладных знаний по финансовой экономике в соответствии с представлениями об этой области, которые сложились в мировом экономическом сообществе в последние три десятилетия. Особое внимание уделено вопросам финансовых инноваций, которые анализируются в широком контексте исторического развития и взаимного влияния финансов, экономики и культуры. Сделан акцент на те направления финансовой экономики, которые сформировались в последнее десятилетие XX в (экзотические опционы, кредитные, страховые и реальные деривативы и др.) и которые еще слабо освещены в литературе на русском языке. Качественный анализ органично связан с математическими моделями и статистикой из авторитетных источников информации. Затронуты и дидактические аспекты эффективного усвоения представленного материала

Хотя основной целевой аудиторией данного пособия являются магистры, обучающиеся по направлению «Экономика», однако, как показал опыт, материал ряда тем вполне доступен и интересен для студентов и магистрантов экономических специальностей вузов и специалистов-практиков

Замечания, предложения и вопросы можно направлять в адрес автора lychagin@nsu.ru.

СОДЕРЖАНИЕ

ПРЕДИСЛОВИЕ АВТОРА

Раздел 1 ВВЕДЕНИЕ В ФИНАНСОВУЮ ЭКОНОМИКУ

- 1.1. Методология финансовых исследований
- 1.2. Финансы история и проблемы современности
- 1.3. Термины и классификации
- 1.4. Анализ публикаций
- 1.5. Финансовые инновации
- 1.6. Изучение финансовых дисциплин и модификации учебной программы

Раздел 2 БАЗОВЫЕ МОДЕЛИ ОЦЕНКИ ОПЦИОНОВ

- 2.1. Опционы исторические предпосылки и общая характеристика
- 2.2. Ценообразование опционов
- 2.3. Модель Блэка—Шоулза
- 2.4. Другие варианты

Раздел 3 ЭКЗОТИЧЕСКИЕ ОПЦИОНЫ

- 3.1. Исторические предпосылки и обзор исследований
- 3.2. Опционы с возможностью траекторного описания (path-dependent options)
- 3.3. Опционы на несколько активов
- 3.4. Сравнительный анализ различных контрактов

Раздел 5 СТРУКТУРИРОВАННЫЕ ПРОДУКТЫ И ГИБРИДНЫЕ ЦЕННЫЕ БУМАГИ

- 5.1. Где найти раздел 4?
- 5.2. Немного из истории облигаций
- 5.3. Структурированные продукты и гибридные ценные бумаги

5.4. Модификация базовых структур при участии магистрантов ЭФ НГУ

Раздел 6 БАНКОВСКИЕ ИННОВАЦИИ И КРЕДИТНЫЕ ДЕРИВАТИВЫ

- 6.1. Становление мирового банковского дела
- 6.2. Инновации и риски в современной банковской деятельности
- 6.3. Кредитные деривативы
- 6.4. Облигации, связанные с кредитом, и числовые иллюстрации

Раздел 7 НОВОВВЕДЕНИЯ НА РЫНКЕ СТРАХОВЫХ УСЛУГ

- 7.1. Страхование история и структуры
- 7.2. Проблемы финансирования здравоохранения
- 7.3. Облигации и деривативы, связанные с погодой, катастрофами и экологией

Раздел 8 ФИНАНСОВЫЕ ИНСТРУМЕНТЫ, СВЯЗАННЫЕ С ТОВАРАМИ, И "РЕАЛЬНЫЕ" ОПЦИОНЫ

- 8.0. Введение в раздел
- 8.1. Преобразования в реальном секторе и финансы
- 8.2. Биржи электроэнергии
- 8.3. "Реальные" опционы
- 8.4. Подведение итогов курса