

**Касимов, Ю. Ф.**

Финансовая математика: учебник и практикум для бакалавриата и магистратуры / Ю. Ф. Касимов. — 5-е изд., перераб. и доп. — М. : Издательство Юрайт, 2014. — 459 с. — Серия : Бакалавр и магистр. Академический курс.

## ОГЛАВЛЕНИЕ

<b>Предисловие к четвертому изданию.....</b>	<b>7</b>
<b>Предисловие.....</b>	<b>9</b>
<b>Глава 1. Финансы и финансовые проблемы.....</b>	<b>13</b>
1.1. Финансовые проблемы и принятие финансовых решений.....	14
1.2. Финансовые модели.....	16
1.3. Инвестирование и инвестиционные активы.....	19
1.4. Кредит. Кредитные сделки и кредитные рынки.....	31
1.5. Коммерческие банки, банковские депозиты и ссуды.....	40
<i>Вопросы и задания для самоконтроля.....</i>	<i>42</i>
<b>Глава 2. Базовые элементы финансовых моделей.....</b>	<b>43</b>
2.1. Временная и денежная шкалы.....	45
2.2. Финансовые события и денежные потоки.....	53
2.3. Финансовые активы.....	67
2.4. Финансовые операции.....	70
2.5. Финансовые процессы.....	77
2.6. Практическая реализация временной шкалы. Элементы финансовой хронологии.....	81
<i>Вопросы и задания для самоконтроля.....</i>	<i>104</i>
<i>Задачи для самостоятельного решения.....</i>	<i>104</i>
<b>Глава 3. Финансовый анализ кредитной сделки.....</b>	<b>106</b>
3.1. Описание и определяющие параметры кредитной сделки.....	107
3.2. Процент, процентная ставка.....	111
3.3. Дисконт, учетная ставка.....	123
3.4. Краткосрочные долговые обязательства.....	130
3.5. Арбитраж и оценивание долговых обязательств.....	149
3.6. Учет инфляции в оценивании простых кредитных сделок. Реальная и номинальная ставки сделки.....	154
<i>Примеры решения задач на простейшие кредитные сделки...</i>	<i>157</i>
<i>Вопросы и задания для самоконтроля.....</i>	<i>162</i>
<i>Задачи для самостоятельного решения.....</i>	<i>162</i>

<b>Глава 4. Простые мультивалютные и срочные сделки...</b>	<b>166</b>
4.1. Основные определения.....	167
4.2. Обменные операции.....	169
4.3. Валютный арбитраж.....	171
4.4. Кросс-арбитраж (3-арбитраж).....	174
<i>Условие возможности валютного арбитража.....</i>	<i>175</i>
4.5. Мультивалютные кредитные сделки.....	176
4.6. Форвардные валютные сделки.....	180
4.7. Срочные кредитные сделки.....	184
<i>Факторы, определяющие уровень процентных ставок.....</i>	<i>187</i>
4.8. Многопериодные валютные сделки.....	196
<i>Вопросы и задания для самоконтроля.....</i>	<i>202</i>
<i>Задачи для самостоятельного решения.....</i>	<i>202</i>
<b>Глава 5. Простые проценты.....</b>	<b>204</b>
5.1. Накопительные счета в схеме простых процентов: динамическая модель роста.....	205
5.2. Приведение денежных сумм в схеме простых процентов.....	215
5.3. Эквивалентность событий в схеме простых процентов.....	220
5.4. Финансовые потоки в схеме простых процентов.....	221
5.5. Схема простых процентов с переменной ставкой.....	222
5.6. Реинвестирование в схеме простых процентов.....	225
<i>Вопросы и задания для самоконтроля.....</i>	<i>227</i>
<i>Задачи для самостоятельного решения.....</i>	<i>227</i>
<b>Глава 6. Модели с переменным капиталом в схеме простых процентов.....</b>	<b>230</b>
6.1. Модель мультисчета в схеме простых процентов.....	231
6.2. Бинарные модели.....	235
6.3. Коммерческое и актуарное правила.....	244
6.4. Потоки платежей в схеме простых процентов.....	256
6.5. Текущая стоимость потока платежей в коммерческой и актуарной моделях.....	261
6.6. Ренты в схеме простых процентов.....	265
<i>Вопросы и задания для самоконтроля.....</i>	<i>268</i>
<i>Задачи для самостоятельного решения.....</i>	<i>269</i>
<b>Глава 7. Обобщенные кредитные сделки и схемы погашения для простых процентов.....</b>	<b>272</b>
7.1. Обобщенные кредитные сделки.....	274
7.2. Регулярные схемы погашения долга для простых процентов.....	280

7.3. Потребительский кредит.....	288
7.4. Нормированные простые ставки обобщенных кредитных сделок.....	291
7.5. Реструктуризация кредитных контрактов в схеме простых процентов.....	298
<i>Вопросы и задания для самоконтроля.....</i>	<i>306</i>
<i>Задачи для самостоятельного решения.....</i>	<i>307</i>
<b>Глава 8. Сложные проценты.....</b>	<b>310</b>
8.1. Формула сложных процентов для модели последовательных простых кредитных сделок.....	310
8.2. Модель накопительного счета в схеме сложных процентов.....	313
8.3. Номинальная и эффективная нормированные ставки.....	320
8.4. Учетные ставки в схеме сложных процентов.....	333
8.5. Эквивалентность ставок в схеме сложных процентов..	336
8.6. Будущая и текущая стоимости денежных сумм в схеме сложных процентов.....	338
<i>Вопросы и задания для самоконтроля.....</i>	<i>341</i>
<i>Задачи для самостоятельного решения.....</i>	<i>341</i>
<b>Глава 9. Модели с переменным капиталом в схеме сложных процентов.....</b>	<b>343</b>
9.1. Дискретная накопительная модель в схеме сложных процентов.....	344
9.2. Преобразование и эквивалентность платежей в схеме сложных процентов.....	353
<i>Вопросы и задания для самоконтроля.....</i>	<i>361</i>
<i>Задачи для самостоятельного решения.....</i>	<i>362</i>
<b>Глава 10. Специальные классы потоков. Ренты.....</b>	<b>364</b>
10.1. Стандартные ренты.....	366
10.2. Нестандартные (р-кратные) ренты.....	379
<i>Вопросы и задания для самоконтроля.....</i>	<i>386</i>
<i>Задачи для самостоятельного решения.....</i>	<i>386</i>
<b>Глава 11. Финансовые операции в схеме сложных процентов.....</b>	<b>389</b>
11.1. Погашение долга.....	392
11.2. Пенсионные схемы.....	411
<i>Вопросы и задания для самоконтроля.....</i>	<i>422</i>
<i>Задачи для самостоятельного решения.....</i>	<i>423</i>

<b>Глава 12. Анализ эффективности инвестиций</b> .....	<b>427</b>
12.1. Поток инвестиционного проекта и его характеристики.....	428
12.2. Сравнение инвестиционных проектов. Полный финансовый план.....	435
12.3. Сравнение инвестиционных проектов. Критерий <i>БРУ</i> .....	444
12.4. Сравнение инвестиционных проектов. Максимизации текущего дохода.....	447
<i>Вопросы и задания для самоконтроля</i> .....	450
<i>Задачи для самостоятельного решения</i> .....	451
<b>Приложения</b> .....	<b>452</b>
<b>Литература</b> .....	<b>458</b>