



Финансовая математика: рук. к решению задач: учеб, пособие /В. П. Кирлица. — Мн. Тетра Системс, 2005. -192 с.

ISBN: 985-470-354-1

Книга является пособием для выполнения лабораторных и практических занятия по курсам "Методы финансово-экономического управления", "Моделирование финансового рынка", "Актuarный анализ" и спецкурсам по финансово-экономическим

расчетам. Предназначена для студентов и магистрантов, обучающихся по финансово-экономическим специальностям; для слушателей факультетов переподготовки и повышения квалификации по этим специальностям, а также работников финансово-кредитных учреждений, предпринимателей, желающих самостоятельно выполнять финансово-экономические расчеты

Оглавление

ОГЛАВЛЕНИЕ

СОДЕРЖАНИЕ

Предисловие	3
Глава 1. НАЧИСЛЕНИЕ ПРОЦЕНТОВ	7
1.1 Формулы наращения и дисконтирования	7
1.2 Определение срока платежа и уровня процентных ставок	14
1.3 Эквивалентность процентных ставок	15
1.4 Конверсия платежей	17
1.5 Наращение и конверсия валюты	19
1.6 Наращение и инфляция	21
1.7 Финансовые операции со случайными параметрами	23
1.8 Задачи и примеры	29
Глава 2. ПОСТОЯННЫЕ ФИНАНСОВЫЕ РЕНТЫ	40
2.1 Наращенная сумма ренты постнумерандо	41
2.2 Современная величина ренты постнумерандо	42
2.3 Определение параметров рент постнумерандо	43
2.4 Наращенная сумма и современная стоимость других видов постоянных рент	45
2.5 Финансовые ренты в страховании	50
2.6 Задачи и примеры	66
Глава 3. ПЕРЕМЕННЫЕ ПОТОКИ ПЛАТЕЖЕЙ	77
3.1 Потоки с разовыми изменениями платежей	77
3.2 Рента с постоянным абсолютным приростом платежей	79
3.3 Рента с постоянным относительным изменением платежей	80
3.4 Непрерывные постоянные потоки платежей	82
3.5 Непрерывные переменные потоки платежей	84
3.6 Задачи и примеры	85
Глава 4. КОНВЕРСИЯ РЕНТ	96
4.1 Изменение параметров рент	96
4.2 Объединение рент	99
4.3 Задачи и примеры	101