

Matematyka finansowa

Mieczysław Sobczyk

SPIS TREŚCI

Rozdział I: Kalkulacja wartości pieniądza w czasie

- 1.1. Uwagi wstępne
- 1.2. Przyszła wartość pieniądza - oprocentowanie proste
 - 1.2.1. Rachunek odsetek prostych
 - 1.2.2. Rachunek procentowy "od sta" i "w stu"
 - 1.2.3. Przeciętna stopa procentowa
 - 1.2.4. Rachunek odsetek prostych dla rocznych jednostek czasu
 - 1.2.5. Regularne wpłaty przy oprocentowaniu prostym
 - 1.2.6. Obliczanie odsetek przy zastosowaniu liczb procentowych
- 1.3. Przyszła wartość pieniądza - oprocentowanie składane
 - 1.3.1. Przeciętna i efektywna stopa procentowa
 - 1.3.2. Strumienie płatności
 - 1.3.3. Realna wartość kapitału
 - 1.3.4. Porównanie oprocentowania składanego z oprocentowaniem prostym
- 1.4. Obecna wartość pieniądza

1.4.1. Uwagi wstępne

1.4.2. Dyskonto proste i składane

1.4.3. Dyskonto handlowe i matematyczne

Zadania

Odpowiedzi do zadań

Rozdział II: Rozliczenia związane ze spłatą długów

2.1. Uwagi ogólne

2.2. Spłata długu w ratach kapitałowych o stałej wysokości

2.3. Spłata długu w stałych kwotach płatności

2.4. Niezgodne spłaty długu w równych ratach kapitałowych i w stałych kwotach płatności

2.5. Spłaty długu o ustalonych ratach kapitałowych lub zadanych kwotach płatności

2.6. Kredyty z opóźnionym okresem spłat

2.7. Kredyty z dodatkowymi opłatami

2.8. Kalkulacja spłaty długu przy wysokiej stopie inflacji

2.9. Średni okres spłaty kredytu

2.10. Efektywny koszt kredytu

Zadania

Odpowiedzi do zadań

Rozdział III: Rachunek efektywności projektów inwestycyjnych

3.1. Uwagi wstępne

3.2. Statyczne metody oceny projektów inwestycyjnych

3.2.1. Okres zwrotu nakładów

3.2.2. Księgowa stopa zwrotu

3.2.3. Metody analizy progów rentowności i wrażliwości projektów inwestycyjnych

3.3. Dynamiczne metody oceny projektów inwestycyjnych

3.3.1. Wartość zaktualizowana netto

3.3.2. Wewnętrzna stopa zwrotu

3.3.3. Zmodyfikowana wewnętrzna stopa zwrotu

3.3.4. Wskaźnik rentowności

3.4. Metody amortyzacji środków trwałych

3.4.1. Metoda liniowa

3.4.2. Metody biorące za podstawę nakłady i efekty

3.4.3. Metody przyspieszonej amortyzacji

Zadania

Odpowiedzi do zadań

Rozdział IV: Wycena papierów wartościowych

4.1. Uwagi wstępne

4.2. Krótkoterminowe inwestycje w papiery wartościowe

4.2.1. Weksle

4.2.2. Bony skarbowe

4.2.3. Certyfikaty depozytowe

4.3. Długoterminowe inwestycje w papiery wartościowe

4.3.1. Obligacje

4.3.2. Akcje

4.4. Portfel papierów wartościowych (analiza portfolio)

Zadania

Odpowiedzi do zadań

Rozdział V: Transakcje leasingowe

5.1. Pojęcie leasingu i charakter umów leasingowych

5.2. Formy leasingu

5.3. Zalety i wady leasingu

5.4. Kalkulacja opłat leasingowych

Zadania

Odpowiedzi do zadań

Aneks

Bibliografia