

Jürgen Tietze

Übungsbuch zur Finanzmathematik

Aufgaben, Testklausuren und Lösungen

3., verbesserte Auflage



Inhalt

Vorwort		V	
Abkürzungen, Variablenamen		X	
		I	II
		Aufgaben	Lösungen
		1	173
1 Voraussetzungen und Hilfsmittel	3	175	
1.1 Prozentrechnung	3	175	
1.2 Lineare Verzinsung und Äquivalenzprinzip	11	177	
1.3 Diskontrechnung	18	184	
2 Exponentielle Verzinsung (Zinseszinsrechnung)	23	187	
2.1 Reine Zinseszinsrechnung und Äquivalenzprinzip	23	187	
2.2 Gemischte, unterjährige, stetige Verzinsung	27	192	
2.3 Abschreibungen	33	197	
2.4 Inflation und Verzinsung	38	200	
3 Rentenrechnung	41	203	
3.1 Standardprobleme (Rentenperiode = Zinsperiode)	41	203	
3.2 Auseinanderfallen von Renten- und Zinsperiode	54	214	
3.3 Renten mit veränderlichen Raten	62	222	
4 Tilgungsrechnung	69	229	
4.1 Standardprobleme der Tilgungsrechnung	69	229	
4.2 Tilgungsrechnung bei unterjährigen Zahlungen	77	240	
5 Die Ermittlung des Effektivzinssatzes in der Finanzmathematik	81	257	
5.1 Grundlagen, Standardprobleme	81	257	
5.2 Effektivzinsermittlung bei unterjährigen Leistungen	89	269	
6 Kurs- und Renditeberechnung bei festverzinslichen Wertpapieren	99	301	
7 Aspekte der Risikoanalyse – das Duration-Konzept	103	309	
8 Derivative Finanzinstrumente – Futures und Optionen	107	315	
9 Investitionen	115	333	
10 Testklausuren 1-18	125	341	
Formelanhang		365	
Literaturhinweise		371	