

Jürgen Tietze

Übungsbuch zur Finanzmathematik

Aufgaben, Testklausuren und ausführliche Lösungen

7., überarbeitete und erweiterte Auflage

STUDIUM



VIEWEG+
TEUBNER

Inhalt

| | | |
|---|----------|----------|
| Vorwort | V | |
| Abkürzungen, Variablenamen | X | |
| | I | II |
| | Aufgaben | Lösungen |
| | 1 | 191 |
| 1 Voraussetzungen und Hilfsmittel | 3 | 193 |
| 1.1 Prozentrechnung | 3 | 193 |
| 1.2 Lineare Verzinsung und Äquivalenzprinzip | 11 | 198 |
| 1.3 Diskontrechnung | 18 | 206 |
| 2 Exponentielle Verzinsung (Zinseszinsrechnung). | 23 | 211 |
| 2.1 Reine Zinseszinsrechnung und Äquivalenzprinzip | 23 | 211 |
| 2.2 Gemischte, unterjährige, stetige Verzinsung. | 27 | 216 |
| 2.3 Abschreibungen. | 33 | 221 |
| 2.4 Inflation und Verzinsung | 38 | 225 |
| 3 Rentenrechnung | 41 | 227 |
| 3.1 Standardprobleme (Rentenperiode = Zinsperiode) | 41 | 227 |
| 3.2 Auseinanderfallen von Renten- und Zinsperiode. | 54 | 242 |
| 3.3 Renten mit veränderlichen Raten | 62 | 250 |
| 4 Tilgungsrechnung. | 69 | 257 |
| 4.1 Standardprobleme der Tilgungsrechnung | 69 | 257 |
| 4.2 Tilgungsrechnung bei unterjährigen Zahlungen. | 77 | 271 |
| 5 Die Ermittlung des Effektivzinssatzes in der Finanzmathematik | 81 | 287 |
| 5.1 Grundlagen, Standardprobleme | 81 | 287 |
| 5.2 Effektivzinsermittlung bei unterjährigen Leistungen. | 90 | 300 |
| 6 Kurs- und Renditeberechnung bei festverzinslichen Wertpapieren | 101 | 333 |
| 7 Aspekte der Risikoanalyse - das Duration-Konzept | 107 | 341 |
| 8 Derivative Finanzinstrumente - Futures und Optionen | 111 | 347 |
| 9 Investitionen | 119 | 365 |
| 10 Testklausuren 1-22. | 131 | 375 |
| Formelmanhang | 421 | |
| Literaturhinweise. | 429 | |