

Vahlens Kurzlehrbücher

Finanzmathematik

Grundlagen und Anwendungsmöglichkeiten in der Investitions- und Bankwirtschaft

von

Prof. Dr. Konrad Wimmer, Eugen Caprano

7., vollständig überarbeitete Auflage

[Finanzmathematik – Wimmer / Caprano](#)

schnell und portofrei erhältlich bei beck-shop.de DIE FACHBUCHHANDLUNG

Thematische Gliederung:

[Mathematik und Statistik](#)

Verlag Franz Vahlen München 2013

Verlag Franz Vahlen im Internet:

www.vahlen.de

ISBN 978 3 8006 4560 2

beck-shop.de

Sachverzeichnis

A

- Abschnittsfinanzierung 86
- Abschreibung 31
 - arithmetisch-degressive 33
 - degressive 32
 - digitale 32, 34
 - geometrisch-degressive 35
 - lineare 32
 - ökonomische 37
- Abzinsungsfaktor 15
- actual/actual-Methode 8
- Agio 91
- AIBD-Methode 124
- Aktienrendite 188
- Annuität 41
- Annuitätenanleihe
 - Kurs einer 117
 - Kurs einer ... bei aufgeschobener Tilgung 122
 - Kurs einer ... mit Restzahlung 118
- Annuitätenmethode 145
- Annuitätenrechnung
 - auf Basis von Nominal- und Effektivkapital 125
- Annuitätentilgung 82
 - mit Konversion 88
- Arbitragefreiheit 176
- Aufgeld 91
 - Rechnen mit eingeschlossenem 96
- Aufzinsungsfaktor 15

B

- Ballonkredit 107
- Barwert 11
- Barwertsimulation 207
- Baseler Zinsschock 207
- Basispoint Value 204
- Braess-Fangmeyer-Methode 128
- Bruttokapitalwert 141

C

- Capital Asset Pricing Model 194
 - Standardform 195
 - und Unternehmensbewertung 199

D

- Differenzinvestition 145, 162
- Disagio 91
- Diskontierung
 - amtliche 11
 - kaufmännische 11
- Diskontierungsfaktor 15
- Duration
 - Bestimmung mit Excel 202
 - nach Macaulay 201

E

- Economic Value Added 173
- Effective Duration 205
- Effektivkonto 79
- Effektivverzinsung 10
 - bei unterjährlichen Zahlungen 123
 - Berechnung der 122
- Effektivzins
 - im Leasinggeschäft 166
- Effektivzinsberechnung 126
- Effizienzlinie 190
- Endwertsimulation 207
- Ergänzungsinvestition 145
- Eulersche Zahl 28
- Eurozinsmethode 8

F

- Finanzierung 131
- Folge 3
 - arithmetische 3
 - geometrische 4
- Forward Rate Aggrement 180
- Forward Rates 177
- Futurekurse
 - Berechnung von 180

G

- Gegenwartsverfahren 72

H

- Habenzinsen 6

I

- ICMA-Verfahren 124
- Interpolationsverfahren 12

- Investition 131
 Investitionsrechnung
 – bei unsicheren Erwartungen 187
 – Berücksichtigung von Steuerwirkungen 168
 – Margenermittlung in der 171
- J**
- Jahreszinssatz
 – nomineller 26
- K**
- Kalkulationszinssatz 132
 Kapitalmarkt
 – vollkommener 132
 Kapitalmarktlinie 191
 Kapitalwert
 – Berechnung mit periodischen Renditen 178
 Kapitalwertfunktion 142
 Kapitalwertmethode 139
 – Interpretation 143
 – marktziensorientierte 174
 Key-Rate-Duration 205
 Kontoführungsmodelle 52
 Konversion 88
 Kreditkonto 79
 Kuponanleihen
 – Kurs bei jährlicher Zinszahlung 115
 – Kurs bei unterjährlicher Verzinsung 116
 Kursberechnung 115
 Kurswertveränderung
 – Abschätzung 203
- L**
- Leistungsabschreibung 31
 Leverage-Effekt 197
 Logarithmen 2
- M**
- Modified Duration 203
 – Bestimmung mit Excel 204
 – und Baseler Zinschock 208
 Moosmüller-Methode 128
- N**
- Nominalverzinsung 10
 Nominalzinssatz 7
- P**
- PAngV 126
 Pay-back-Methode 133
 Pensionsrückstellungen
 – Berechnung unter Einbeziehung von Sterbewahrscheinlichkeiten 74
 – Berechnung von 71
 Portefeuille-Theorie 187
 Portfolio Selection 187
 Potenzen 1
 Preisangabenverordnung 126
 Price Value of a Basis Point 204
 Prozentannuität 86
- R**
- Ratenkredit 106
 – mit Bearbeitungsgebühr 110
 – ohne Bearbeitungsgebühr 107
 Ratenschuld
 – Begebungskurs einer 120
 – Kurs einer 119
 – Kurs einer ... mit Aufgeld 121
 Ratentilgung 81
 Reihe 3
 – arithmetische 3
 – geometrische 4
 Rendite
 – Berechnung der 122
 Rente 41
 – arithmetisch fortschreitende 65, 67
 – arithmetisch fortschreitende ewige 70
 – Berechnung der Laufzeit 50
 – Bestimmung der Rentenrate 49
 – Bestimmung des Gesamtwertes einer 47
 – ewige 68
 – geometrisch fortschreitende 65, 66
 – geometrisch fortschreitende ewige 70
 – konstante ewige 68
 – Kurs einer ewigen 117
 – nachschüssige Jahresrente 42
 – progressive 65
 – unterjährliche 52
 – vorschüssige Jahresrente 43
 Rentenbarwert
 – nachschüssiger 43
 – vorschüssiger 44
 Rentenendwert 43
 Rentenzahlungen
 – unterjährliche 57
 Return on Risk Adjusted Capital 193
 Risiko
 – eines Wertpapiers 188
- S**
- Separationsprinzip 193
 Serienanleihe 96
 Sollzinsen 6
 Sondertilgung 88
 Spot Rates 177

T

- Teilwertverfahren 72
- Teilzahlungskredite 106
- Tilgung 91
 - Annuitätentilgung mit Aufgeld 95
 - Annuitätentilgung mit Gebührenverrechnung 93
 - eines Annuitätendarlehens 83
 - mit Aufgeld 92
 - Raten- 81
 - tilgungsfreie Zeiten 82
 - unterjährliche Annuitätentilgung 99
 - von Serienanlehen 96
- Tilgungsplan 83
- Tilgungsrechnung 79
- Tilgungsverrechnung
 - verzögerte 100

U

- Unternehmensbewertung 199
- US-Leasing-Methode 128

V

- Value at Risk 209
- Vermögensendwertmethode 152
- Vermögenswertmethoden 134
- Verzinsung
 - gemischte 21
 - kontinuierliche 28
 - nachschüssige 6, 29
 - stetige 27
 - unterjährliche 26
 - vorschüssige 6, 29
- Vollständiger Finanzplan 134
- Vorfälligkeitsentschädigung 114, 182

W

- Wechseldiskontierung 11
- Wiederanlageprämisse
 - der internen Zinssatzmethode 161
- Wurzeln 1

Z

- Zahlungsplan 52
- Zahlungsreihe 133
- Zahlungsstromkongruenz-Modell 177
- Zahlungstermin
 - mittlerer 23
- Zerobondabzinsfaktoren 176
- Zero Rates 177
- Zins
 - einfacher 7
- Zinsänderungsrisiko 201
- Zinsanleihe
 - mit Rücklagentilgung 91
- Zinseszinsverbot 15
- Zinsformel
 - amtliches Rechnen 8
 - deutsche Methode 8
 - englische Methode 8
 - französische Methode 8
 - kaufmännische 7
- Zinsfuß 6
- Zinsimmunsierung 205
- Zinsintensität 29
- Zinskapitalisierung 7
- Zinsrechnung 5
- Zinssatz
 - bei vorschüssiger Verzinsung 15
 - effektiver 26
 - konformer 26
 - relativer 26
- Zinsschuld
 - mit Aufgeld 116
- Zinssensitivität 204