Aktualisierungen, Verbesserungen und Fehlerkorrekturen **Stand: 27.8.2020**

zu Pfeifer, A.: Finanzmathematik Übungsbuch mit Formelsammlung

	statt	korrekt bzw. besser
S. 40, 3. Zeile von oben	Black/Scholes	Black/Scholes/Merton
S. 40, 5. Z. v. o.	Basispreis K	Basispreis X
S. 49; 8. Z. v. o. Tabelle	Volatilität p.a.	Volatilität p.a. des Diskontierungsfaktors
S. 60, Aufgabe 1.3.4c	> 31,5/32 · …	< 31,5/32 · …
S. 68, 19. Z. v. o	1.000 € (1 + 6/12 · 0,02)	[1.000 € (1 + 6/12 · 0,029)
S. 72; 9. Z. v. o.	10,145%	10,015%
S. 72, 16. Zeile. v. o., 18. Zeile von oben und S. 73, 1. Z. v. o.	2.600 €	26.000 €
S. 92, 3. Z. von unten, Aufg. 6.2.3b)	$1 + (1+i_{eff})^{-2}$	$1 - (1+i_{eff})^{-2}$
S. 93, 2. Zeile der Aufg. 6.2.3d)	$1 + (1+i_{eff})^{-2}$	$1 - (1+i_{eff})^{-2}$
S. 94, 4. Z. v. o.	40,3023 Jahre	40,303 Jahre
S. 95, 10. Z. von unten	6,18606	6,185606 (= Schätzung nach der Bankenformel)
S. 95, 9. Zeile v. u.	ergibt sich	ergibt sich mit dem Sekantenverfahren
S. 95, 1. Zeile v u.	6,412%	6,244%
S. 116, 21. Z. v. oben	2 € – 630 € 600 € · (1 + 0,04)	–2 € + 630 € – 600 € · (1 + 0,04) (Lagerung) (Ertrag aus Aktie) (Rückzahlung Kredit)
S. 123, 6. Z. v. u.	Call-Preises benutzt	Put-Preises benutzt
S. 133, 12. Z. v. u	$\frac{\partial PV_{Call}}{\partial S}$	$\frac{\partial PV_{Call}}{\partial r_d}$
S. 134, 17. Z. v. o.	$\sigma_{0,25}^2 = 0,4 \cdot \sqrt{0,25} = 0,04$	$\sigma_{0,25}^2 = 0,4^2 \cdot 0,25 = 0,04 = 0,2^2$
S. 153, 7. Z. v. o.	N(0,90) = 1,282	$q_{0,90}^{SN} = 1,282$
S. 156, 12. Zeile von unten	$\cdot\ (1 + \frac{9}{12} \cdot i_{FRA_{fair}})$ $= 102.082,82$ €.	$\cdot\ (1 + \frac{6}{12} \cdot i_{FRA_{fair}}) = 102.572,35$ €.
S. 156, 8. Z. v. u.	= 4,165634%	= 5,144695%
S. 157, Aufg. 11.11 bei VaR_2	$VaR_2 = \ \ldots\ \cdot 0,43 = 71,81$ €.	$VaR_2 = \ \ldots\ \cdot 0,4 = 71,81$ €.
S. 158, 7. Z. v. u.	10,986	11,90304666
S. 200, 14.. Z. v. o. Präziser:	Der Value-at-Risk, bezeichnet … erfüllt.	Der Value-at-Risk, bezeichnet mit VaR oder VaR(H, c), ist die kleinste positive reelle Zahl aller Zahlen w mit der Eigenschaft $P(\Delta PV < -w) \leq 1 - c$.