

ERRATA CORRIGE

27 maggio 2013

- Pag. 2, riga 6 a partire dal fondo della pagina:

ERRATA:

Si ottengono dunque gli stessi risultati con il comando:

```
> rendimenti<- diff(log(x))
```

CORRIGE:

Si ottengono dunque gli stessi risultati con il comando:

```
> rendimenti<- diff(log(x))[-1,]
```

se x è di tipo `timeSeries` (si veda la Sezione 1.4). In tal caso, infatti, la funzione `diff` rispetta la struttura dell'oggetto `timeSeries` ponendo la prima osservazione a `NA` (che quindi eliminiamo). È possibile applicare il comando `returns` anche ad oggetti non di tipo `timeSeries`, ma il suo funzionamento si discosta parzialmente da quello illustrato qui e nel prosieguo della trattazione.

- Pag. 23, riga 4:

ERRATA: `print(exc1)`

CORRIGE: `print(exc2)`

- Pag. 23, riga 7:

ERRATA: `print(exc2)`

CORRIGE: `print(exc1)`

- Pag. 28, riga 15:

ERRATA: `dlogSP500<- diff(logSP500)`

CORRIGE: `dlogSP500<- diff(logSP500)[-1,]`

- Pag. 43, riga 15:

ERRATA: *sotto l'ipotesi che $E(X_t)$, $\text{var}(X_t)$ e $\text{cov}(X_t, X_s)$ esistano e siano finiti*: in mancanza di tale assunzione nulla si può dire sul rapporto logico tra queste due proprietà.

CORRIGE: *sotto l'ipotesi che $E(X_t)$, $\text{var}(X_t)$ e $\text{cov}(X_t, X_s)$ esistano e siano finiti*.

- Pag. 111, riga 2:

ERRATA:

```
> sigmahat<- sqrt(sum((exp(-r*T1)*PF++ CallPrice)^2)/(B-1))
```

CORRIGE:

```
> sigmahat<- sqrt(sum((exp(-r*T1)*PF-CallPrice)^2)/(B-1))
```

- Pag. 118, riga 11:

ERRATA:

```
> f<- function(x,S,K,r,T1,P)
+ {
+   S*pnorm((log(S/K)+(r+x^2/2)*T1)/(x*sqrt(T1)))-
+   K*exp(-r*T1)*pnorm((log(S/K)+(r-x^2/2)*T1)/
+   (x*sqrt(T1)))-P
+ }
> xmin <- uniroot(f,c(0.01,10),tol=.Machine$double.eps,
+ S,K,r,T1)
> out <- list(Volatility,xmin$root)
```

CORRIGE:

```
> f<- function(x,S,K,r,T1,P)
+ {
+   S*pnorm((log(S/K)+(r+x^2/2)*T1)/(x*sqrt(T1)))-
+   K*exp(-r*T1)*pnorm((log(S/K)+(r-x^2/2)*T1)/
+   (x*sqrt(T1)))-P
+ }
> xmin <- uniroot(f,c(0.01,10),tol=.Machine$double.eps,
+ 39,40,0.02,0.5,1.927437)
> out <- list(xmin$root,xmin$f.root)
```

- Pag. 118, riga 20:

ERRATA: la terza riga trova

CORRIGE: la seconda riga trova

- Pag. 175, riga 12 dal fondo della pagina:

ERRATA:

```
> PD<- pnorm((log(soglia/S0)-(mu-sigma^2/2))/sigma,0,1)
```

CORRIGE:

```
> PD<- pnorm((log(soglia/S0)-(mu-sigma^2/2))/(sigma*sqrt(T1)),0,1)
```