

CAP. 18

PAG. 685

DISTRIBUZIONE DI FREQUENZA

$$1) = \ln \left(\frac{P_{t+1}}{P_t} \right) \times i_{RENDIMENTO}$$

$$2) = \pi_{in} \left(\begin{array}{|c|} \hline \square \\ \hline \square \\ \hline \square \\ \hline \square \\ \hline \square \\ \hline \end{array} \right)$$

$$3) = \pi_{AX} \left(\begin{array}{|c|} \hline \square \\ \hline \square \\ \hline \square \\ \hline \square \\ \hline \square \\ \hline \end{array} \right) \rightarrow \text{restituiti}$$

$$4) \text{ lunghezza intervallo} = \left(\frac{\pi_{AX} - \pi_{in}}{30} \right)$$

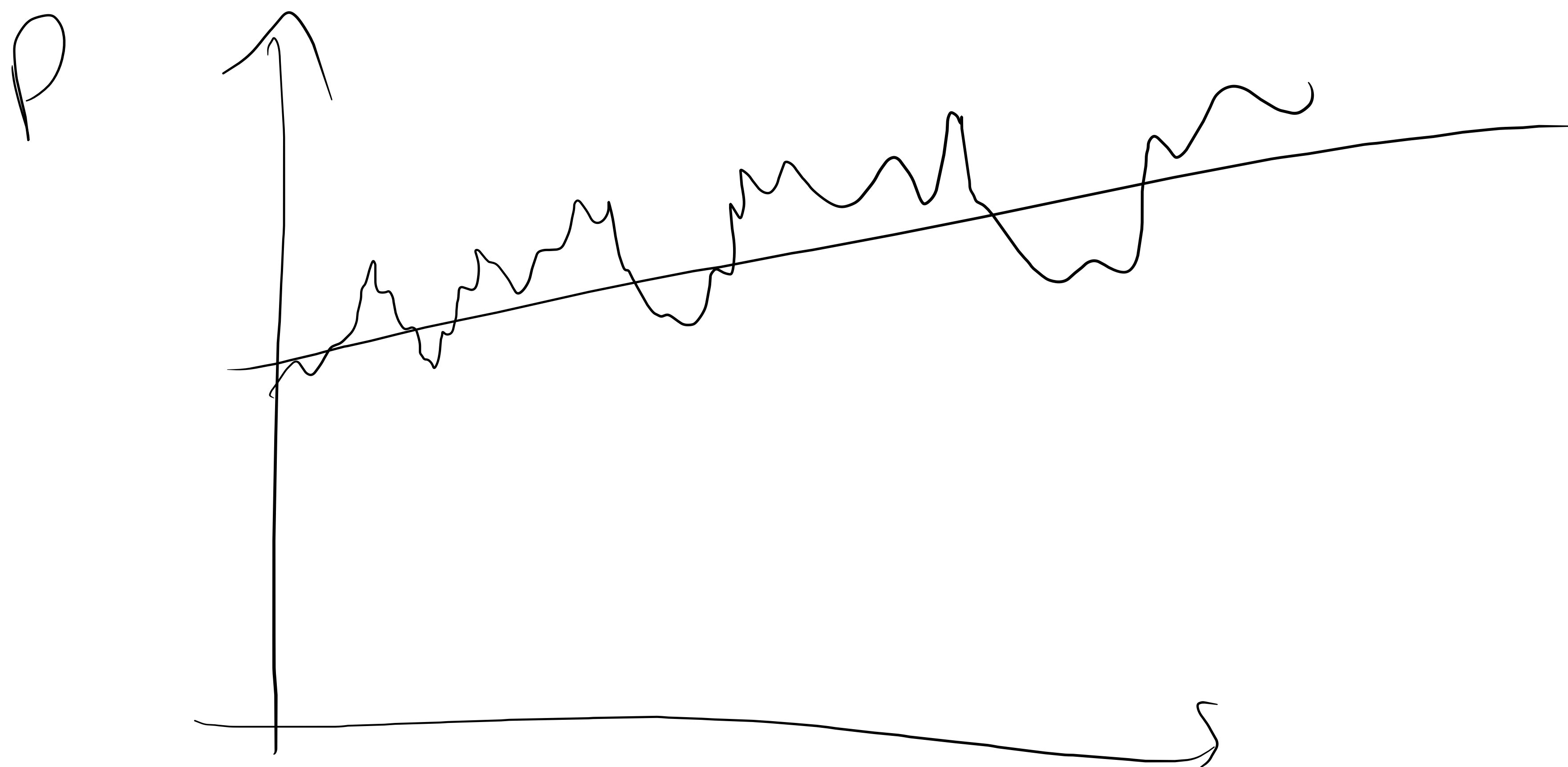
= FREQUENZA (MATRICE DATI ; MATRICE CLASSI)

↓
SERIE di
Rendimenti
Sep 500



SIMULAZIONE SENTIERO DI PREZZO

PAG. 494



ESTRAZIONE CASUALE

$N(0,1)$

$$P_{t+1} = P_t e^{\mu \Delta t + \sigma \cdot z \cdot \sqrt{\Delta t}}$$

Dati / ANALISI DATI

Ordina e filtra

Strumenti dati

Previsione

Analisi

N	O	P	Q
		Time	estraz casuale
Mean	15%	0	
Sigma	30%	1	
at	0,004	2	
initial stock price	35	3	
		4	
		5	
		6	
		7	
		8	
		9	
		10	
		11	
		12	
		13	
		14	
		15	
		16	

Generazione di un numero casuale

Numero di variabili:

1

OK

Numero di numeri casuali:

250

Annulla

Distribuzione:

Normale

?

Parametri

Media =

0

Deviazione standard =

1

Generatore:

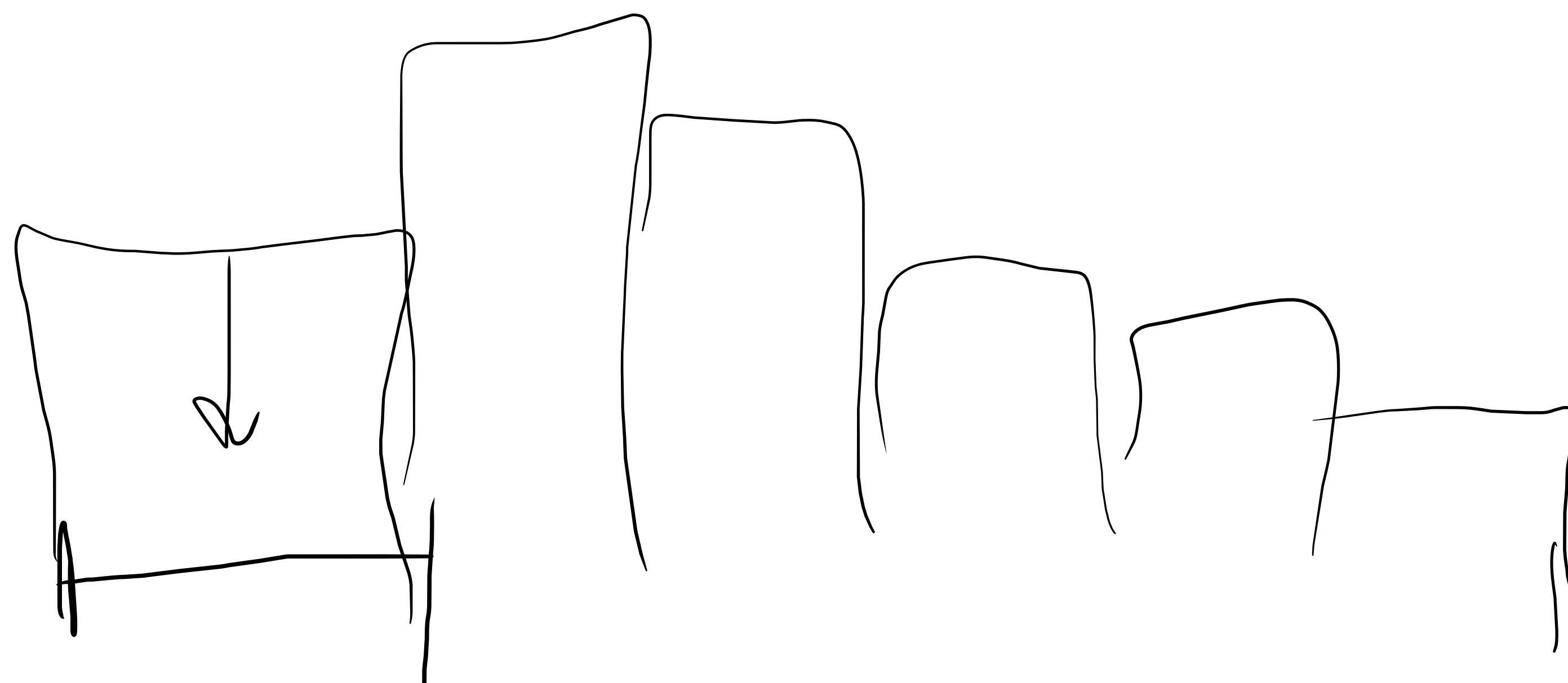
Opzioni di output

☒ Intervallo di output:

\$Q\$3

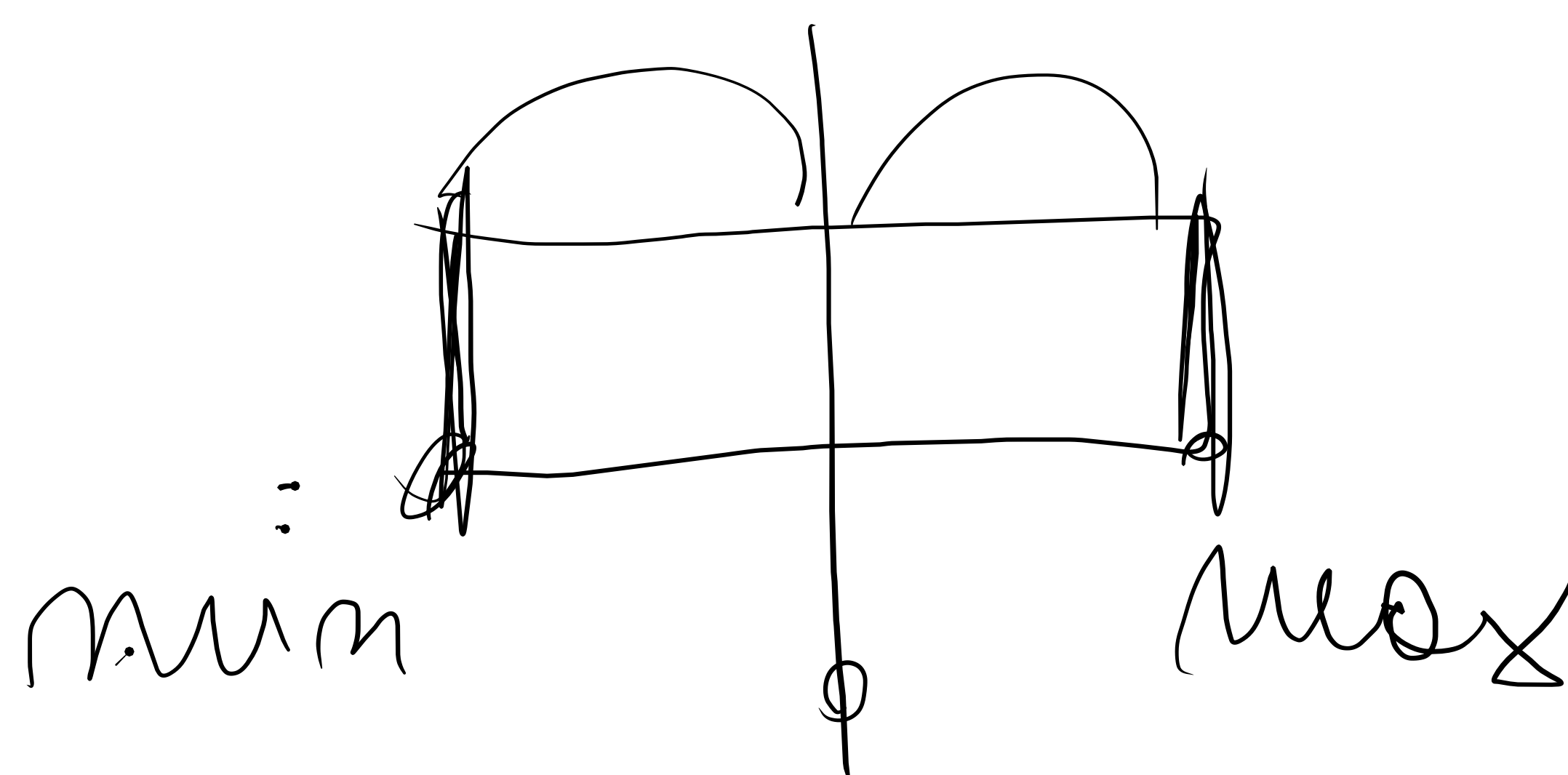
☐ Nuovo foglio di lavoro:

☐ Nuova cartella di lavoro



min - 0,0264
- 0,028

max



variazione casuale	prezzo
	35
-1,12735961	34,27986
-1,146042905	33,56263
-1,522057573	32,62681
-0,46858986	32,35742
-0,537975211	32,04804
0,781164999	32,5461
0,390306241	32,8077
0,95192263	33,42568
-1,255166353	32,65864
1,098092071	33,36623
-0,515040028	33,06159
1,391522346	33,96649
0,062501613	34,0272
-1,267540028	33,23855
-0,201904413	33,13134
-1,404737304	32,27931



PAG. 696

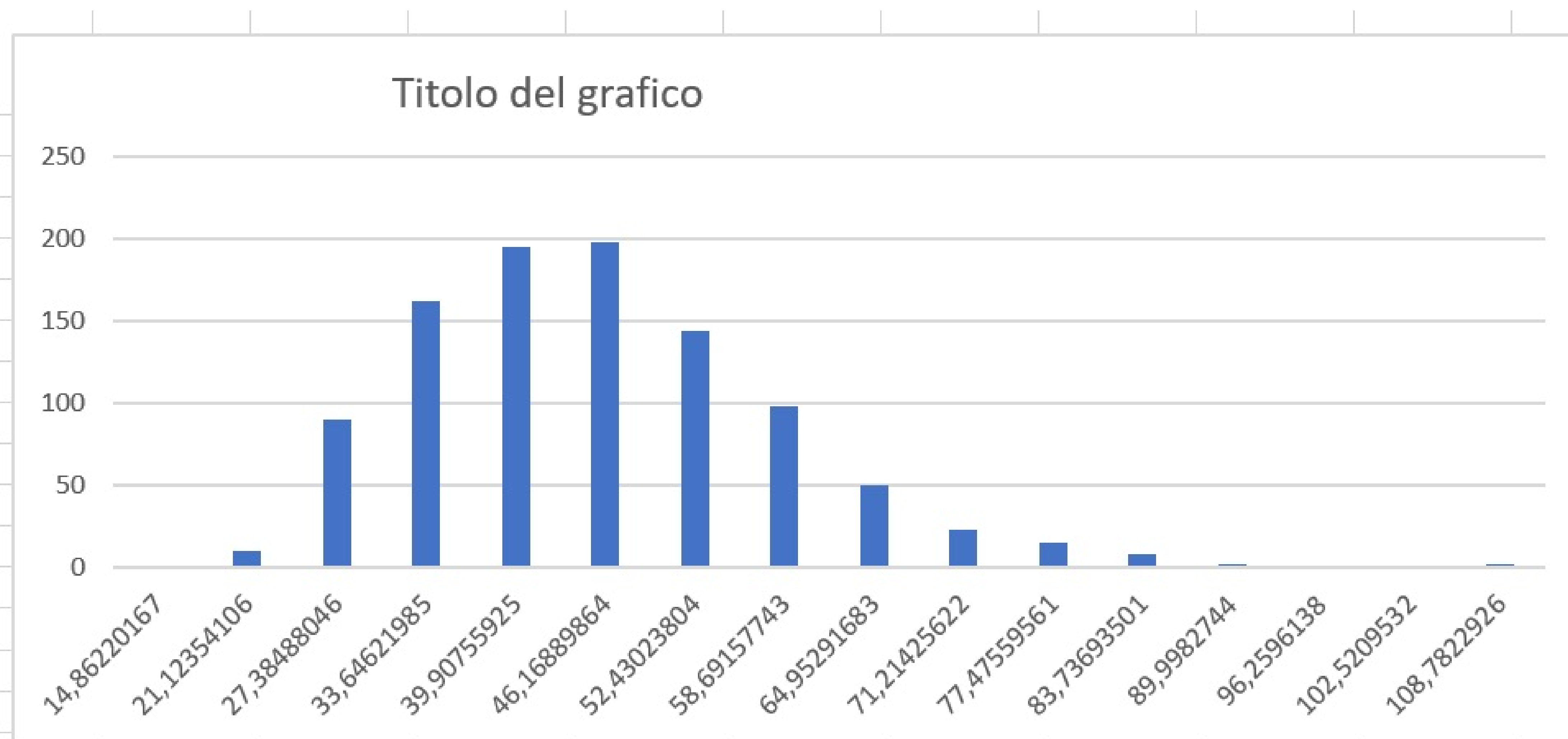
FARE GRAFICO DELLA DISTRIBUZIONE

LOG-NORMALE

$$P_{1\text{anno}} = 35 \cdot e^{\frac{1}{\sigma} \left(\mu + z \sqrt{\sigma^2} \right)} = 35 \cdot e^{\mu + z \sigma}$$

$$\Delta t = 1 \text{ Anno}$$

	matrice classi	
	14,86220167	1
	21,12354106	10
	27,38488046	90
	33,64621985	162
	39,90755925	195
ea del tracciato	46,16889864	198
(,20%, 882)	52,43023804	144
	58,69157743	98
	64,95291683	50
	71,21425622	23
	77,47559561	15
	83,73693501	8
	89,9982744	2
	96,2596138	1
	102,5209532	1
	108,7822926	1



CAP. 10

MATRICE VARIANZA - COVARIANZA

PAG. 292-295

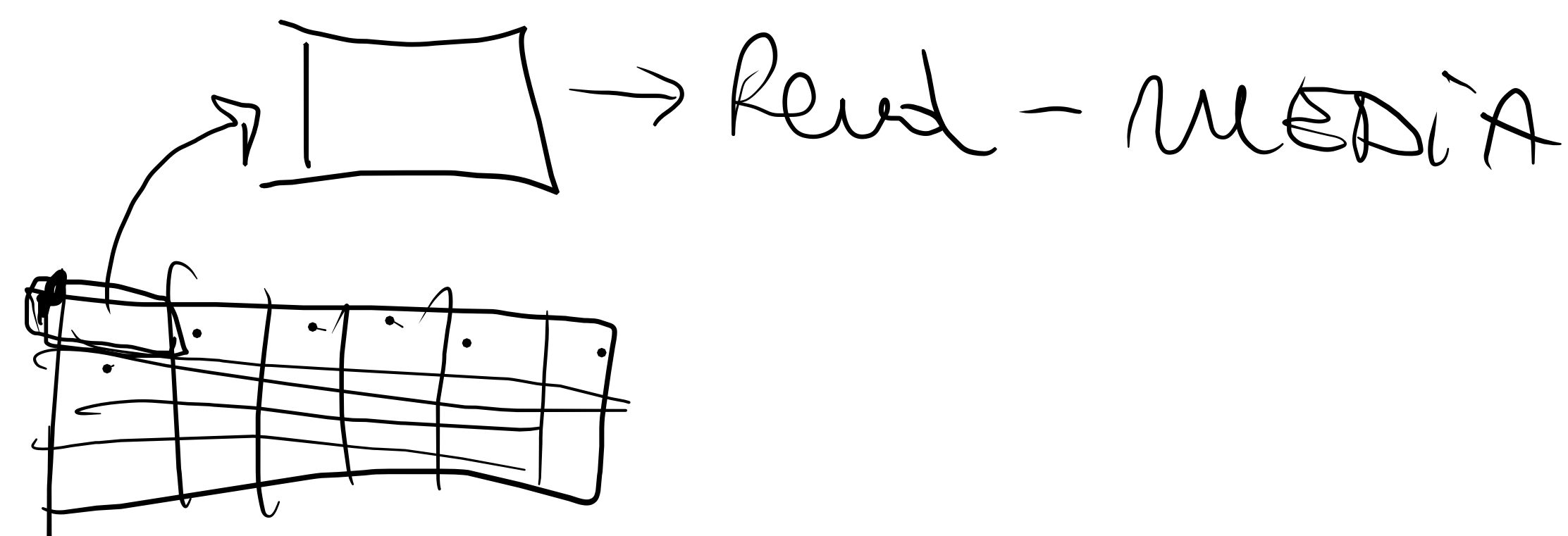
6 Tiroli

1) ACCOLO RENDIMENT = $Pr \left(\frac{P_{t+1}}{P_t} \right)$

2) CALCO REDIE RENDIMENTI = REDIA $\left(\begin{array}{c} \square \\ \square \\ \square \\ \square \\ \square \end{array} \right)$

3) MATRICE DEI RENDIMENTI ADDIZIONALI

||
A

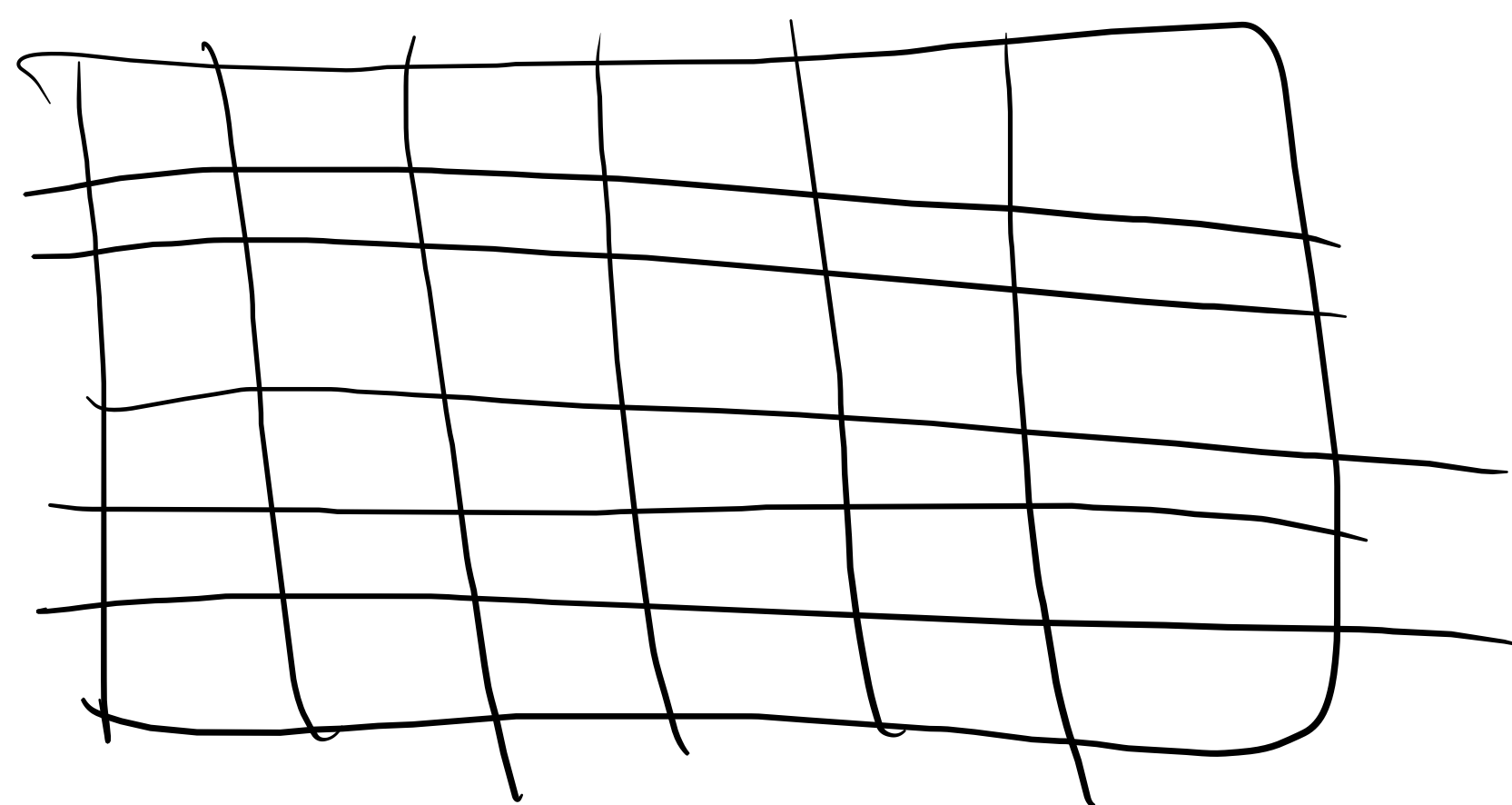


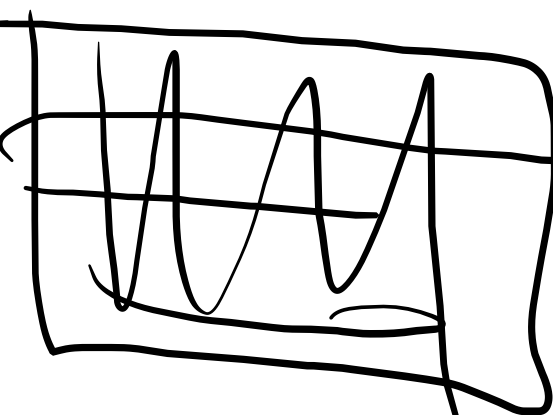
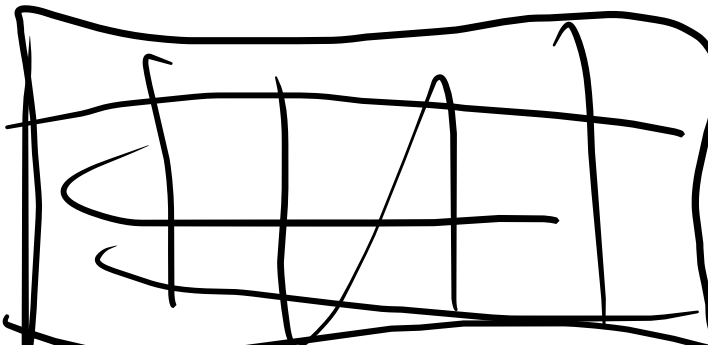
$$G = \underline{A^T \cdot A} = \text{MATR VAR-COV}$$

n° di osservazioni

//
11

SELEZIONO 6x6



= MATR. PRODOTTO (MATR. TRASPOSTA  ; ) // 11

CTRL + SHIFT + ENTER

0,33	-0,23	-0,12		-0,15	0,31	0,04	matrice rendimenti aggiuntionali
-0,05	0,12	0,23		0,02	-0,28	-0,12	
0,33	0,23	0,39		0,32	0,38	0,10	
0,19	0,58	0,05		-0,11	0,27	0,23	
0,23	0,17	-0,01		0,27	0,09	-0,15	
0,11	0,64	0,08		-0,16	-0,13	-0,20	
0,04	-0,10	-0,15		-0,54	0,16	0,06	
-0,19	-0,69	-0,08		0,06	0,01	0,04	
-0,43	-0,17	0,05		0,14	-0,43	-0,13	
-0,68	-0,51	-0,24		0,05	-0,51	-0,02	
0,12	-0,03	-0,20		0,10	0,12	0,14	
0,094	0,069	0,020	-0,004		0,078	0,011	matr var-cov
0,069	0,151	0,037	-0,005		0,034	-0,002	
0,020	0,037	0,033	0,016		0,009	-0,004	
-0,004	-0,005	0,016	0,052		-0,007	-0,004	
0,078	0,034	0,009	-0,007		0,081	0,023	
0,011	-0,002	-0,004	-0,004		0,023	0,017	
0,011	covarianza IBM e GE				0,017	varianza IBM	