Assignment: (Return) Predictability 2

Download monthly KOSPI index from yahooFinance. Convert the Adj Close to obtain the return series. Use the Goyal and Welch data to predict the KOSPI returns and report the out-of-sample R2 for (i) each predictor and (ii) all predictors using expanding window from the beginning to the prediction month (at least 5 year window). [the command of flipud(.) flips the input upside/down]

<< result of (i) >>

테이블이(가) 표시된 사진

자동 생성된 설명

<< result of (ii) >>

텍스트, 신문이(가) 표시된 사진

자동 생성된 설명 테이블이(가) 표시된 사진

자동 생성된 설명 테이블이(가) 표시된 사진

자동 생성된 설명