Y：預期**日**報酬率

方法：**使用一點**比較斜率與CDF

|  |
| --- |
| 迴歸模型結果：    **Skewness**於10% 顯著水準下顯著  **Median**於5% 顯著水準下顯著  **前4期報酬**於10% 顯著水準下顯著 |

Y：預期**日**報酬率

方法：**使用兩點**比較PDF

|  |
| --- |
| 迴歸模型結果：    **Skewness**不顯著  **Median**於5% 顯著水準下顯著  **前4期報酬**於10% 顯著水準下顯著  解釋：一個點的方式算出來的**Skewness**較有解釋力 |

Y：預期**週**報酬率

方法：**使用一點**比較斜率與CDF

|  |
| --- |
| 迴歸模型結果：    **Kurtosis**於10% 顯著水準下顯著  **Median**於5% 顯著水準下顯著  **Fear and Greed Index**於10% 顯著水準下顯著  解釋：在週報酬當Y時居然是Kurtosis才會顯著，Interesting！ |

Y：預期**週**報酬率

方法：**使用兩點**比較PDF

|  |
| --- |
| 迴歸模型結果：    **Kurtosis**於10% 顯著水準下顯著  **Median**於5% 顯著水準下顯著  **Fear and Greed Index**於5% 顯著水準下顯著  解釋：在週報酬當Y時居然是Kurtosis才會顯著，Interesting！ |