

วิชา ศ. 435 (กลุ่ม อ.เฉลิมพงษ์) ภาค 2/2560
แบบฝึกฝนหัวข้อ 6 (ไม่ต้องส่ง)

1. (10 คะแนน) นักศึกษาต้องการศึกษาความสัมพันธ์ระหว่างดัชนีตลาดหลักทรัพย์ไทย (SET) และมาเลเซีย (KLSE) ว่ามีความสัมพันธ์กันหรือไม่ จงตอบคำถามต่อไปนี้ โดยใช้ข้อมูลจาก ps5_2.txt [คอลัมน์แรกคือดัชนีราคา SET และ คอลัมน์ที่สองคือดัชนีราคา KLSE]
 - (a) (2 คะแนน) จงทดสอบ unit root ในดัชนีราคา SET และ KLSE
 - (b) (4 คะแนน) จงทดสอบ cointegration ของดัชนีราคา SET และ KLSE โดยใช้วิธี Engle-Granger พร้อมอธิบายผลการทดสอบอย่างละเอียด
 - (c) (4 คะแนน) จงประมาณค่าแบบจำลอง Error Correction Model พร้อมเขียนผลการประมาณค่า
 - (d) จงทดสอบ cointegration โดยใช้วิธีของ Johansen พร้อมเขียนผลการประมาณค่าจาก VECM