

การบ้านครั้งที่ 1 วิชา EC 435 ภาค 1/2563

(กำหนดส่งวันศุกร์ที่ 28 สิงหาคม 2563 เวลา 9:45 น. ในชั้นเรียน)

จากหน้าที่ได้รับมอบหมายในตอนท้ายของการบ้าน

1. เข้าเว็บ <https://finance.yahoo.com/>
2. ในช่องค้นหาให้ใส่รหัสหุ้นตามด้วย .BK เช่น AOT.BK แล้วคลิกค้นหา
3. ในแถบเมนูเลือก Historical Data
4. เปลี่ยน Time Period เป็น 01/02/2017 ถึง 07/31/2020 แล้วคลิก Apply
5. เมื่อได้ข้อมูลตามต้องการคลิก Download Data

จงตอบดำเนินการและตอบคำถามต่อไปนี้

1. คำนวณ log return โดยใช้ราคาปิด (close) แล้ว plot รูป log return
2. คำนวณ sample mean, sample standard deviation, sample skewness, sample kurtosis
[Hint: ฟังก์ชันใน Excel สำหรับ skewness และ kurtosis คือ SKEW และ KURT]
3. จงทดสอบว่าค่าเฉลี่ยของ log return มีค่าเท่ากับศูนย์หรือไม่
4. จงทดสอบว่า skewness ของ log return มีค่าเท่ากับศูนย์หรือไม่
5. จงทดสอบว่า excess kurtosis ของ log return มีค่าเท่ากับศูนย์หรือไม่
6. จงทดสอบว่า log return มีการแจกแจงแบบปกติหรือไม่