

การบ้านครั้งที่ 1 วิชา EC 435 ภาค 1/2562

(กำหนดส่งวันศุกร์ที่ 30 สิงหาคม 2562 เวลา 9:45 น. ในชั้นเรียน)

จากหุ้นที่ได้รับมอบหมายในตอนท้ายของการบ้าน

1. เข้าเว็บ <https://finance.yahoo.com/>
2. ในช่องค้นหาให้ใส่รหัสหุ้นตามด้วย .BK เช่น AOT.BK แล้วคลิกค้นหา
3. ในแถบเมนูเลือก Historical Data
4. เปลี่ยน Time Period เป็น 01/01/2017 ถึง 12/31/2018 แล้วคลิก Apply
5. เมื่อได้ข้อมูลตามต้องการคลิก Download Data

จงตอบดำเนินการและตอบคำถามต่อไปนี้

1. คำนวณ log return แสดงผลตอบแทน 10 วันแรก และ plot รูป log return โดยระบุหุ้นที่ได้รับมอบหมาย
2. คำนวณ sample mean, sample standard deviation, sample skewness, sample kurtosis
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

ADVANC	5904490025	5904680450
AOT	5904490033	5904680518
BANPU	5904520045	5904680625
BBL	5904530010	5904680633
BDMS	5904610143	5904680658
BEM	5904610176	5904680708
BGRIM	5904610242	5904680799
BH	5904610309	5904680807
BJC	5904610366	5904680815
BPP	5904610382	5904680823
BTS	5904610473	5904680831
CBG	5904610507	5904680930
CPALL	5904610572	5904680997
CPF	5904610770	5904681011
CPN	5904610796	5904681037
DELTA	5904610820	5904681060

DTAC	5904610929	5904681078
EA	5904611117	5904681102
EGCO	5904611133	5904681110
GLOBAL	5904611174	5904681151
GPSC	5904611216	5904681177
GULF	5904611331	5904681219
HMPRO	5904611422	5904681235
INTUCH	5904611448	5904681342
IRPC	5904680013	5904681375
IVL	5904680047	5904681391
KBANK	5904680088	5904681425
KKP	5904680120	6004610389
KTB	5904680310	6004680010
KTC	5904680328	6004680176
LH	5904680401	5904611323
MINT	5904680419	5904610325