

วันที่ 29/10/2561

สิ่งที่ทำ

- ศึกษา Market impact cost จากบทความ www.quantinsti.com/blog/market-impact-cost
- ศึกษาปัจจัยที่มีผลกับการประมาณค่า Market impact cost ซึ่งผลจากการศึกษาพบว่า มีปัจจัยดังนี้ Trading Size, Volatility, Percentage Of Volume
- ศึกษางานวิจัย Predicting Market Impact Costs Using Nonparametric Machine Learning Models
- ทำการ Preprocess Data หุ่นจาก SEHK ให้เป็นค่าดังนี้ input สำหรับการทำนายค่า Size, Volatility, Percentage of Volume และ output เป็น Market impact Cost เพื่อนำสร้างเป็น Model ในต่อไป

ปัญหาที่พบ

- เนื่องจาก Data ของหุ้นเป็น time scale รายนาทิจำนวนมาก ทำให้การประมาณผลข้อมูลนั้นใช้เวลาค่อนข้างนาน

สิ่งที่จะทำต่อไป

- Preprocess Data ให้ครบทั้ง 26 ตัว
- ศึกษา grid search และ neural network เพื่อใช้ในการสร้าง Market Impact Estimation Model