

วันที่ 30/9/2561

สิ่งที่ทำ

ศึกษาหนังสือ The Science of Algorithmic Trading and Portfolio by Robert Kissell ในบทที่ 4 Market Impact Models ซึ่งสิ่งที่ได้รู้ในบทนี้คือ

- นิยามของ Market Impact และปัจจัยต่างๆที่มีผล
- Temporary Market Impact
- Permanent Market Impact
- I-Star Model
- AC Model

ปัญหาที่พบ

ยังไม่ค่อยเข้าใจเกี่ยวกับการใช้งานในทางปฏิบัติและขั้นตอนการหา parameter

สิ่งที่จะทำต่อไป

ศึกษาต่อในบทการประมาณค่า parameter ของ Market Impact Model