

วันที่ 5/10/2561

สิ่งที่ทำ

- ทำการ Preprocess Data หุ่นจาก SEHK ที่จะใช้ในการสร้างโมเดลประมาณ Market Impact Cost ทั้งหมด 26 ตัว ให้เป็นค่าดังนี้ input สำหรับการทำนายค่า Size, Volatility, Percentage of Volume และ output เป็น Market impact Cost ณ ปัจจัย Input ดังกล่าว
- ทดลอง fit กับ model Support Vector Machine Regression และประเมินผลลัพธ์ที่ได้

ปัญหาที่พบ

- เนื่องจาก Data ของหุ้นเป็น time scale รายนาทิจำนวนมาก ทำให้การประมาณผลข้อมูลนั้นใช้เวลาค่อนข้างนาน

สิ่งที่จะทำต่อไป

- ทดลองกับ Machine Learning Algorithm แบบอื่นๆ