**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 หุ้นจาก SEHK ให้เป็นค่าดังนี้ input สำหรับการทำนายค่า Size, Volatility, Percentage of Volume และ output เป็น Market impact Cost เพื่อนำสร้างเป็น Model ในต่อๆไป

**ปัญหาที่พบ**

* เนื่องจาก Data ของหุ้นเป็น time scale รายนาที ทำให้มีค่าจำนวนมาก ทำให้การประมาณผลข้อมูลนั้นใช้เวลาค่อนข้างนาน

**สิ่งที่จะทำต่อไป**

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