

Posudek vedoucího diplomové práce

Student: Bc. Patrik Charamza
Číslo studenta: E15709
Název diplomové práce: Predikce akciových výnosů pomocí analýzy sentimentu sociálních médií
Cíl práce: Cílem práce je shrnout současné přístupy k predikci akciových výnosů, charakterizovat přístupy k analýze sentimentu, provést sběr dat ze sociálních médií a analýzu sentimentu těchto textů, použít tato data společně s indikátory technické analýzy k predikci akciových výnosů.
Vedoucí práce: doc. Ing. Petr Hájek, Ph.D.
Studijní program: N6208 Ekonomika a management
Akademický rok: 2018/2019

Náročnost tématu

	výborně	velmi dobře	vyhovující	nevyhovující	nelze hodnotit
Teoretické znalosti	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Vstupní údaje a jejich zpracování	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Použité metody	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>

Kritéria hodnocení práce

	výborně	velmi dobře	vyhovující	nevyhovující	nelze hodnotit
Stupeň splnění cíle práce	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Původnost zpracování tématu	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Adekvátnost použitých metod	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Hloubka provedené analýzy (ve vztahu k tématu)	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Logická stavba práce a rozsah	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Práce s českou a zahraniční literaturou včetně citací	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Formální úprava práce (text, grafy, tabulky)	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Jazyková úroveň (styl, gramatika, terminologie)	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>

Využitelnost výsledků práce

	vysoká	střední	nízká	nelze hodnotit
Pro teorii	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Pro praxi	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>

Identifikace záznamu:

Agenda závěrečných prací

.....

Ostatní připomínky k práci

Predikce akciových výnosů pomocí sentimentu získaného z příspěvků na sociálních médiích je v současnosti jedním z nejčastěji diskutovaných problémů v oblasti finančních trhů. V literatuře bylo empiricky dokázáno, že včasnou detekcí změny v sentimentu investorů lze dosáhnout abnormálních akciových výnosů. Diplomant přistoupil k řešení problému logicky. Nejprve prezentuje teoretický přehled analýz finančních trhů. Analýza sentimentu vychází z psychologické analýzy, proto jí věnuje odpovídající pozornost. Jako zdroj dat pro analýzu sentimentu na sociálních médiích je zde použit Yahoo Finance, který společně s Twitterem reprezentuje nejčastější zdroj dat pro obdobné studie. Výsledkem sběru dat bylo více než 85 tisíc příspěvků pro z hlediska tržní kapitalizace 20 největších amerických společností. Tato hrubá textová data diplomant vhodnými metodami předzpracoval a dále použil několik slovníkových metod pro určení sentimentu v daný den pro danou společnost. Nad rámec zadání porovnal jak slovníky všeobecné (autorů Bing a Liu), tak slovníky specificky navržené pro oblast financí. Výsledky této analýzy diplomant detailně diskutuje. Dále tyto výsledky využívá v kapitole 2.3 pro predikci denních akciových výnosů. Tato analýza je také zpracována v souladu s teoretickými předpoklady a poskytuje tak spolehlivé výsledky pro závěrečné zhodnocení.

Vyjádření k výstupům ze systému Theses

Kontrola plagiátorství: nejvyšší míra podobnosti 0 %, práce není plagiát.

Otázky a náměty k obhajobě

V rámci obhajoby podrobněji diskutujte omezení navrženého predikčního systému a jeho další možná rozšíření.

Závěrečné hodnocení

Práci **doporučuji** k obhajobě.

Tuto diplomovou práci navrhuji hodnotit známkou: **A**

V Pardubicích 20.5.2019

Podpis