

Abstrakt

Tato práce zkoumá vliv sentimentu na sociálních sítích a v novinových titulcích na ceny akcií, konkrétně porovnává společnosti z herního průmyslu s firmami z ostatních odvětví. Tweety obsahující klíčová slova odkazující na čtyři vybrané firmy z herního průmyslu a čtyři jiné firmy byly sbírány po dobu 5 měsíců, novinové titulky potom 3 měsíce. Tweety a zprávy pocházely od běžných uživatelů a medií, nikoliv pouze z finanční oblasti. Pro každou zkoumanou společnost, byla sbírána také denní data o cenách akcií za účelem výpočtu výnosů a volatilit. K analýze dat byl využit model vektorové autoregrese v kombinaci s Grangerovou kauzalitou. Studie neprokázala žádný významný rozdíl mezi herním a neherním sektorem. Polarita sentimentu významně neovlivňovala tržní ceny. Nicméně, když byl sentiment rozdělen na jednotlivé emoce, byla pozorována určitá signifikantnost, výsledky se ale lišily u jednotlivých firem, bez ohledu na jejich odvětví. Byl učiněn závěr, že při využití sentimentu pro předpovídání trhu je vhodné využít výhradně finanční média nebo určit konkrétní typ sentimentu, který ovlivňuje zvolené akcie.

Klasifikace JEL	G14, G17, C32, C58
Klíčová slova	tweety, titulky zpráv, herní průmysl, analýza sentimentu, emoce, výnosy, volatilita
Název práce	Vliv zpráv na ceny a volatilitu akciového trhu videoherního průmyslu