

Predikce tržního rizika s využitím analýzy sentimentu

Tržní riziko je důležitým ukazatelem pro mnoho subjektů napříč celým finančním systémem. Tyto subjekty se pokoušejí o jeho co nejlepší pochopení, měření a řízení. S rozvojem investičních platforem a celkově snazším přístupem k investování v posledních letech se čím dál tím více projevuje vliv individuálních charakteristik investorů na jejich rozhodování a potažmo celý trh. Právě tržní sentiment je hnacím motorem způsobujícím zdánlivě abnormální růst či pokles aktiv, který jsme mohli pozorovat např. během nedávné pandemie nemoci COVID 19. Takové pohyby trhů pak mohou být problémem při analýze a řízení tržního rizika. Cílem disertační práce je vylepšení predikčních modelů tržního rizika díky inkluzi vlivu tržního sentimentu. K dosažení cíle práce budou použity různé ekonometrické metody, mimo jiné techniky strojového učení.