

Abstrakt

V této práci jsem se zabýval krátkodobým vlivem Twitteru na trhy. Stahoval jsem anglické tweety z období mezi 9. březnem a 4. dubnem, společně s tweety obsahující slova a hashtagy "apple", "microsoft", "boeing", "cocacola". Následně jsem zkoumal pomocí multinomiální a binomiální penalizované logistické regrese, jestli je možné predikovat trhy pomocí frekvence slov na trhu. Po použití out-of-sample predikce jsem zjistil, že tato metoda není vhodná pro predikci trhů, ale může poskytnout ex-post zajímavý vhled do vztahu sociálních sítí a trhů.