

Abstrakt

Tato práce je zaměřená na odkrytí vztahů mezi emocemi obsaženými v příspěvcích prezidenta Spojených států amerických na Twitteru a pohyby indexů akciových trhů. Komentářům na denní bázi dvou po sobě jdoucích amerických prezidentů, Baracka Obamy a Donalda Trumpa, jsou přiřazeny hodnoty intenzity jejich sentimentu použitím lexicon-based modelu VADER. Tato analýza se dále zabývá testováním Grangerovy kauzality pomocí vektorové autoregrese s dvěmi proměnnými. Tři hlavní akciové indexy jsou použity v této práci, DJIA, S&P 500 and NASDAQ. Výsledky přináší statisticky významnou Grangerovu kauzalitu v případě vztahu prvních diferencí logaritmů DJIA and S&P 500 a časovou řadou sentimentu Baracka Obamy.