

FinNews-Sentiment2Signal

金融新闻情感分析与市场预测

1. 项目简介

本项目围绕金融新闻/公告等非结构化文本进行情感分析，并将情感信号与股票/指数市场数据进行关联研究。目标是在作品集集中展示：将 NLP/LLM 技术与金融时间序列结合、完成特征工程、相关性分析与可视化展示、并产出可解释洞见。

核心亮点：① 处理金融新闻文本并提取情感特征；② 将情感指数与市场行情（收盘价、涨跌、成交量等）对齐；③ 探索基于情感的择时信号；④ 可视化展示结果并撰写研究解读，体现从数据到结论的完整链路。

2. 数据与方法

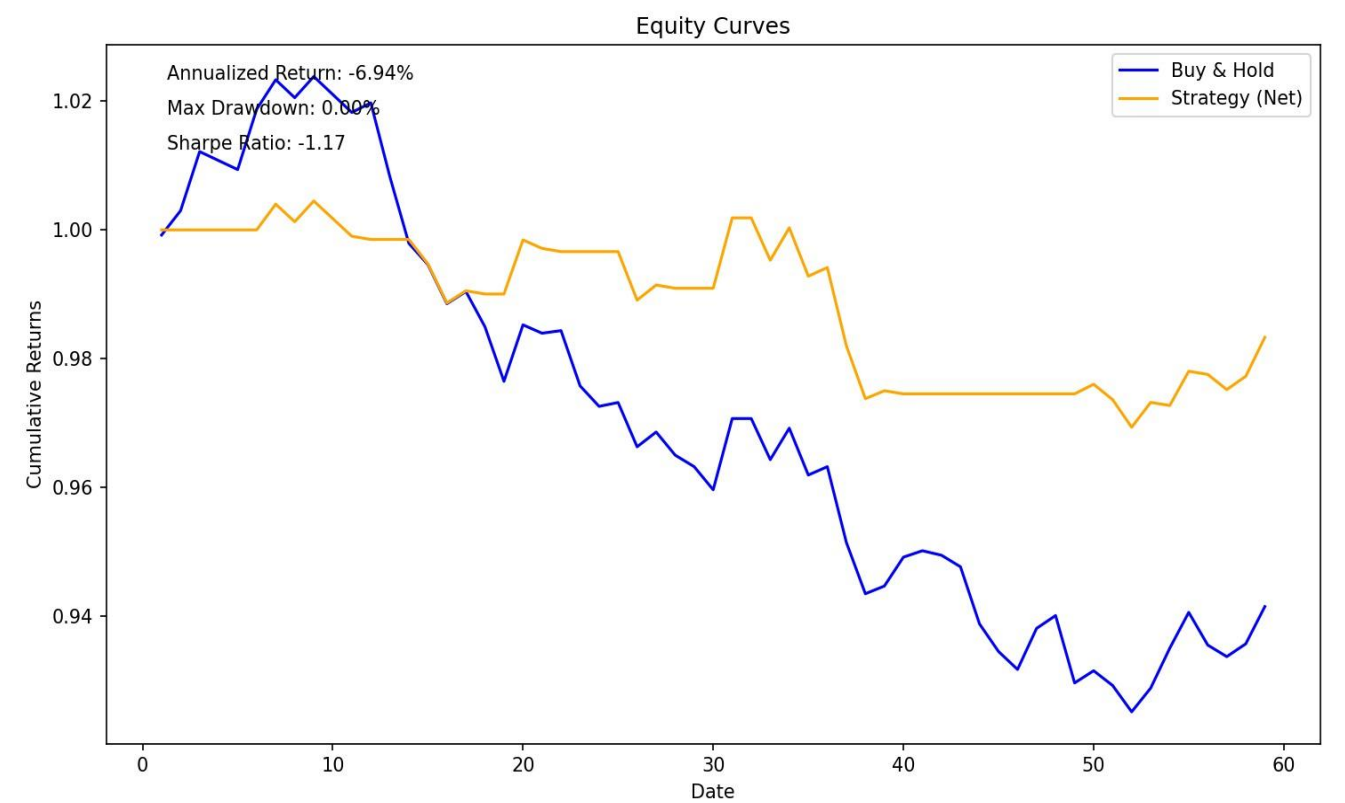
数据：金融新闻/公告文本样本与相应日期的市场数据（指数或个股）。

文本：清洗→编码→情感分类（正/中/负）→按日聚合为情感指数。

关联：将情感指数与收盘价/收益/量能对齐，观察相关性与可能的滞后效应。应用：据情感指数设定简易阈值或移动均值规则，生成方法演示级择时信号。

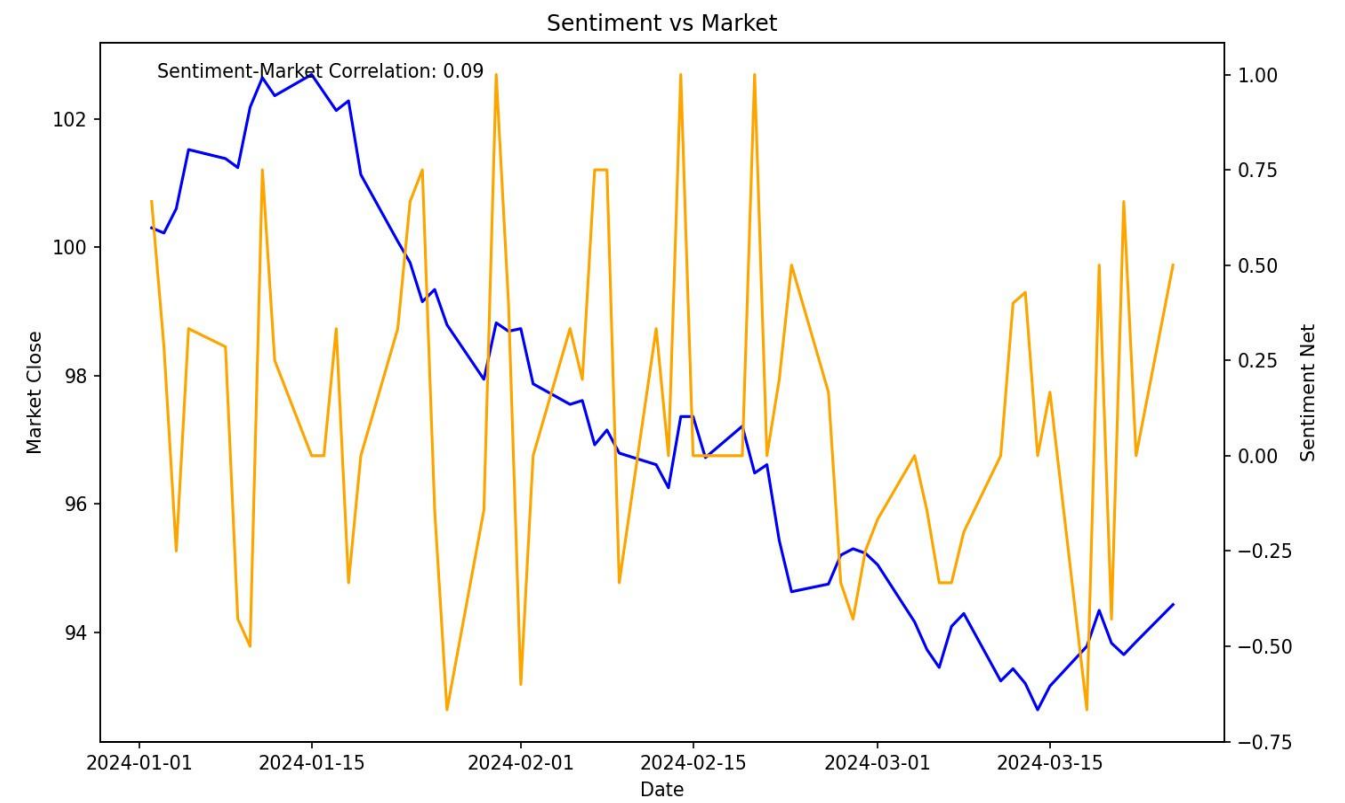
3. 结果可视化

3.1 收益曲线（策略 vs 买入并持有）



图示策略净值与买入并持有的对比表现。整体看，策略曲线波动较大，阶段性超额并不稳定。仅凭单一情感因子构建信号的稳健性有限，后续宜配合风险控制与多因子验证。

3.2 情感分数与市场收盘价对比



情感分数存在明显波动，与指数价格并非强同向。局部时段出现“情感异动、价格滞后”，说明情绪可作为补充指标，但直接映射到价格变化的强度有限。可进一步考察：情绪强度分层、1-3 日滞后效应、与成交量/波动率的共振。

4. 回测与评估（方法要点）

维度	说明
评估目标	以情感指数构建简易择时信号，并与买入持有进行对比。
核心指标	年化收益率、最大回撤、风险调整收益（如夏普比率）等。
稳健性	考察不同窗口/阈值、训练期/验证期切分、不同市场阶段鲁棒性。
合规与风控	仅为研究演示；实盘须考虑交易成本、滑点与风控约束。

结论要点：当前样例下，情感与价格的相关性有限，更像“情绪温度计”。若要形成更稳定的交易信号，建议引入多源文本（公告、研报、社媒）、采用情感强度/主题因子、更细的滞后设定，并结合风险预算与仓位管理。