

# 1주차 발표

1조 김정현

# 학위논문

Energy Economics 122 (2023) 106711



Contents lists available at [ScienceDirect](#)

Energy Economics

journal homepage: [www.elsevier.com/locate/eneeco](http://www.elsevier.com/locate/eneeco)



## Oil price volatility and new evidence from news and Twitter

Hooman Abdollahi

*School of Business and Economics, UiT-The Arctic University of Norway*



Contents lists available at [ScienceDirect](#)

International Review of Economics and Finance

journal homepage: [www.elsevier.com/locate/iref](http://www.elsevier.com/locate/iref)



## Intelligent portfolio construction via news sentiment analysis

Ming-Chin Hung<sup>a</sup>, Ping-Hung Hsia<sup>b</sup>, Xian-Ji Kuang<sup>c</sup>, Shih-Kuei Lin<sup>c,\*</sup>

<sup>a</sup> Department of Financial Engineering and Actuarial Mathematics, Soochow University, Taipei, Taiwan

<sup>b</sup> Cruxover Company, LTD., New Taipei City, Taiwan

<sup>c</sup> Department of Money and Banking, National Chengchi University, Taipei, Taiwan

## 시계열 데이터 (주식, OIL 등)

- 후행성 발생, 변동성 등 변수가 많은 시계열 데이터
- 관련 뉴스 기사들의 감성 분석 결과를 시계열 데이터 모델로 넣으면 정확성을 높일 수 있지 않을까?

## 맡은 역할

- WTI (서부텍사스산원유 가격) 와 관련된 뉴스들을 크롤링, 필요없는 기사들 제거
- 긍정/부정 기사인지 분류
- 시계열 모델에 넣을 수 있도록 데이터 가공

# Challenge?

- 감정 분석 모델을 이미 존재하는, Finetuning도 완료된 모델을 가져다 사용할지, 데이터셋을 찾아서 새롭게 파인튜닝할지?
- 가격 하락 / 상승 소식을 전하는 게 대부분인 주식 관련 뉴스. 유의미한 기사들을 어떻게 걸러낼 수 있을지? Or 하락 / 상승 소식 자체가 미래를 예측하는 데에 유의미하게 사용될지?