



CTBC Project Report



投資因子分析

QUESTION DEFINITION

- 找出不同環境下，專業投資人的投資因子
- 根據結果、建一投資組合，並觀察追蹤其報酬率

Bill Ackman

PERSHING SQUARE CAPITAL
MANAGEMENT



Datasets



CNBC

- 美股新聞 (2013-now)
- 免費

ROCKET FINANCIAL

- 美股財報
- 資料齊全、免費

DATAROMA

- 機構投資人每季持股變化

Pre-processing

共現圖

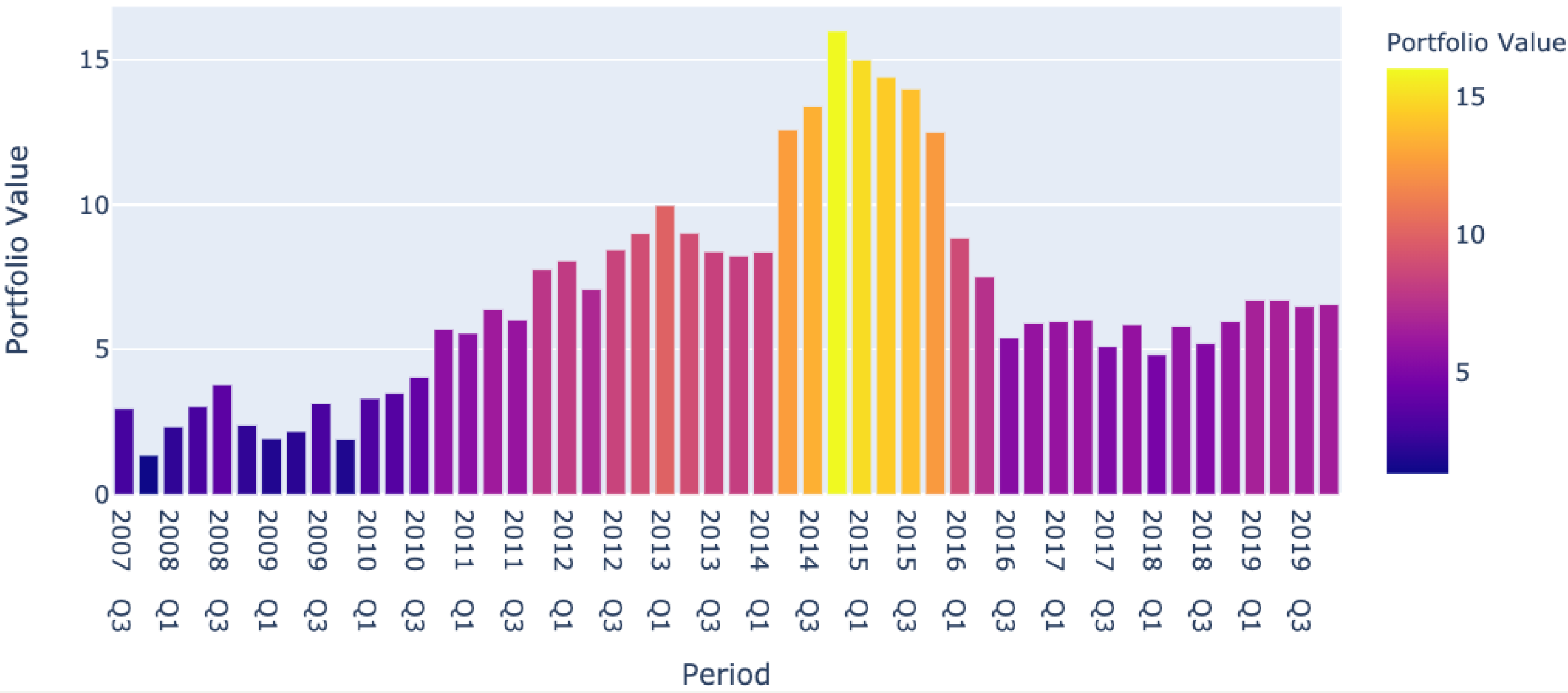
- 1.新聞資料
- 2.日期切割成年月日
- 3.刪除同stop words、標點符號
- 4.詞性分類
-->計算關鍵詞出現次數

投資組合迴歸

- 1.財報留下需要的欄位
- 2.計算個股投資因子
- 3.計算投組投資因子
--> 找投組投資因子迴歸式

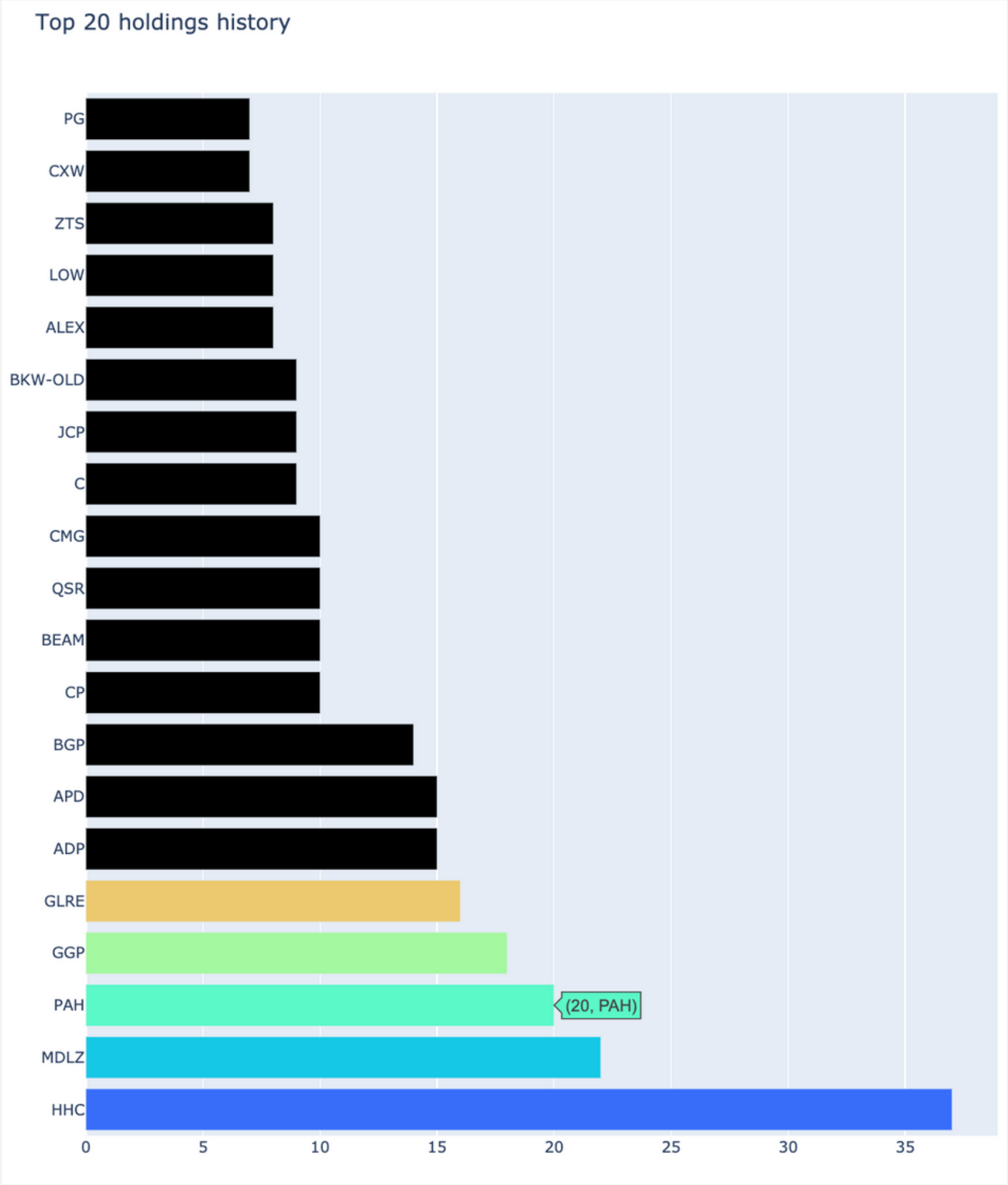


PORTFOLIO VALUE



TOP 20 holding history

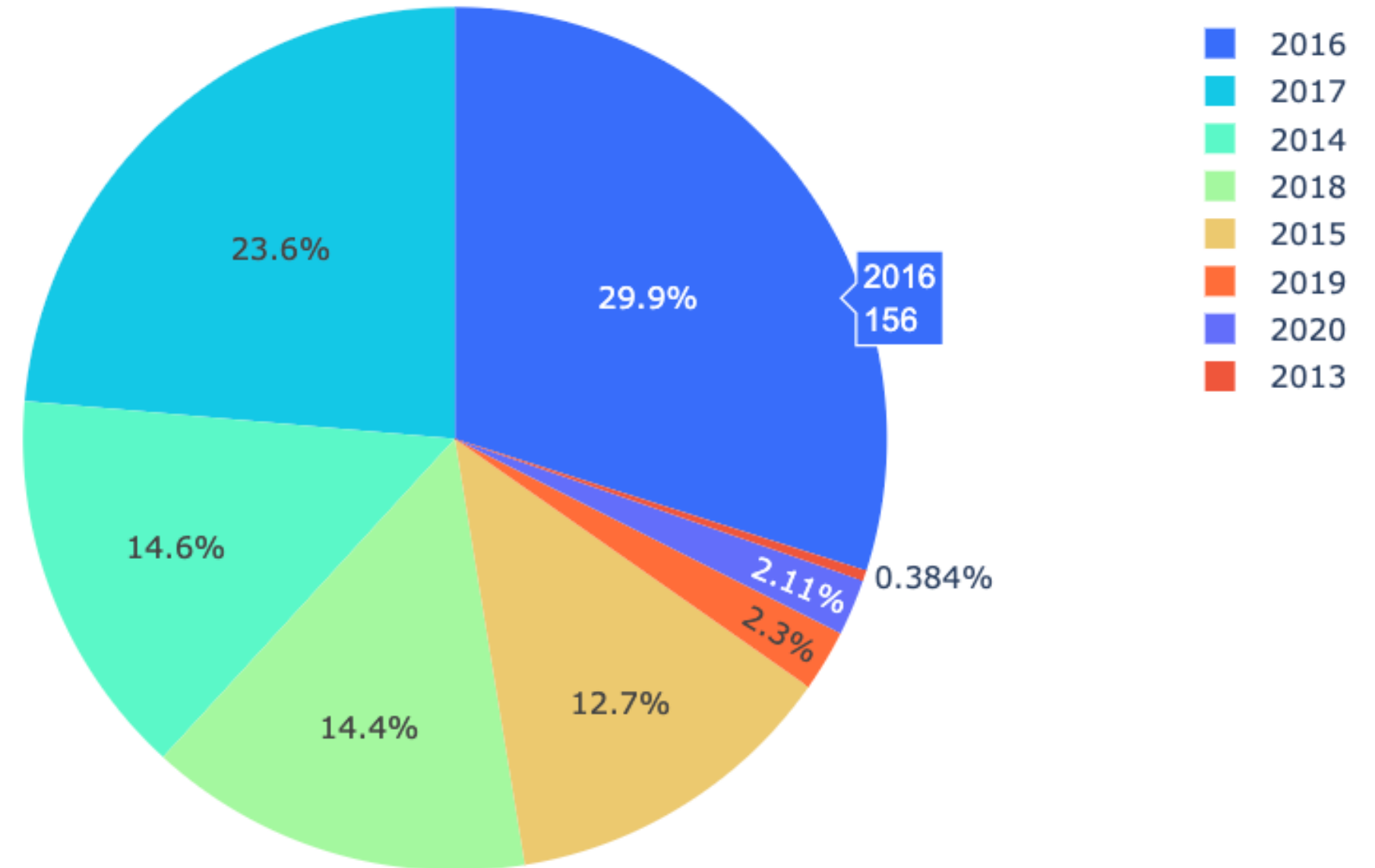
- 1. HHC
- 2. MDLZ
- 3. PAH
- 4. GGP
- 5. GLRE



NEWS

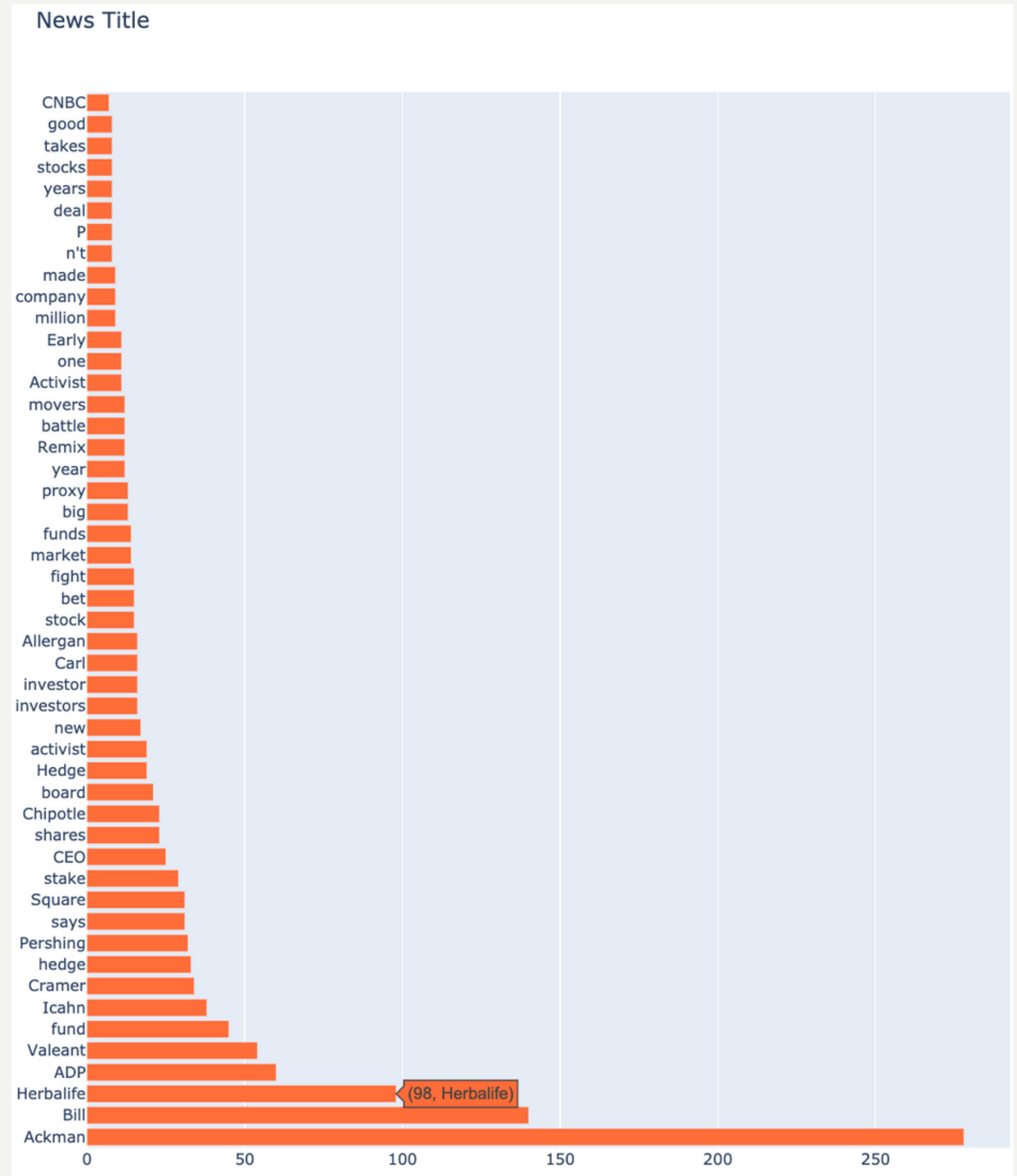
2013-2016

News Amount each year



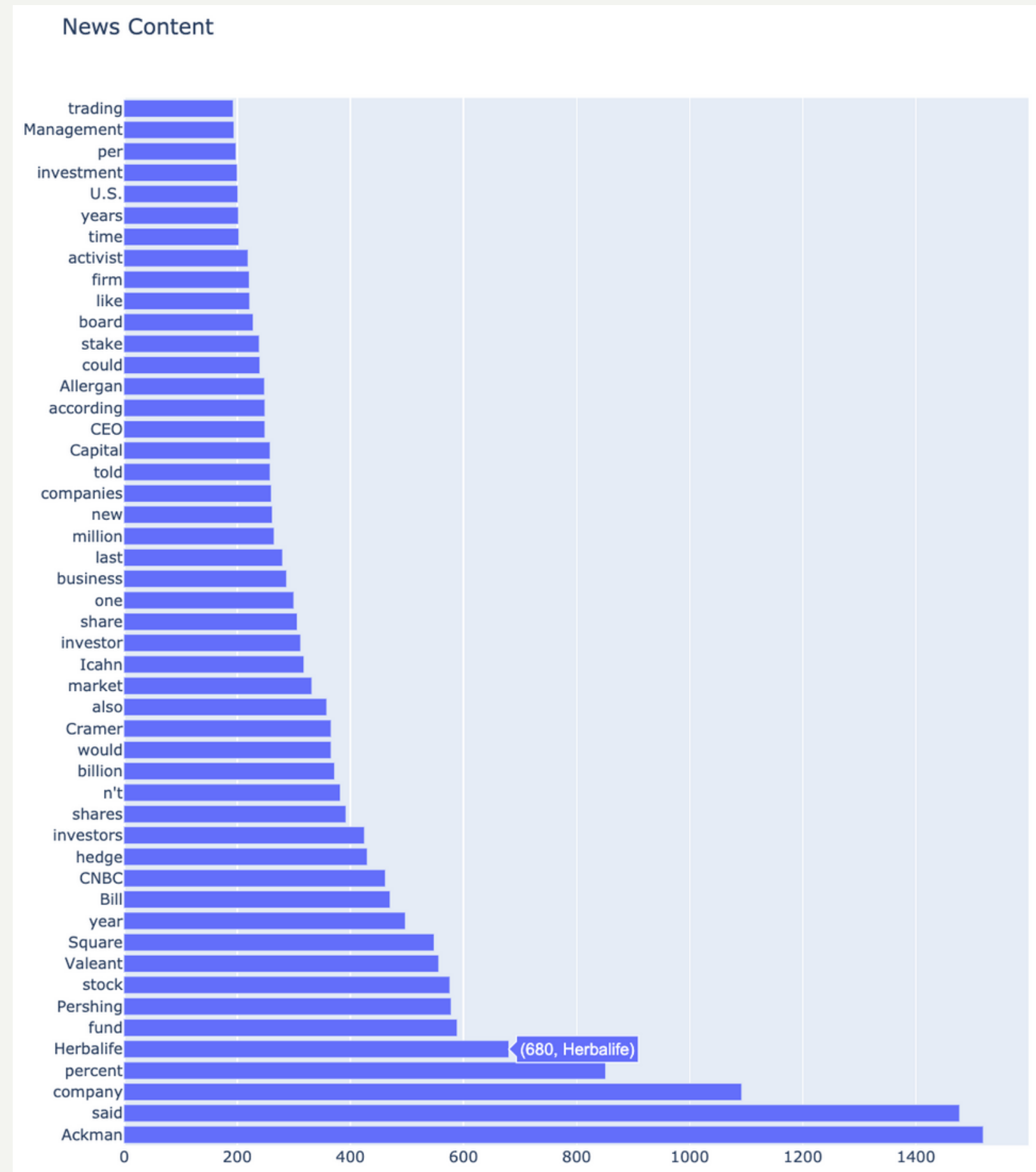
NEWS TITLE

2013-2016



NEWS CONTENT

2013-2016





How to solve problem ?

1. 定義問題
2. 討論、達成共識
3. 查資料
4. 請教教授、專家

OH! WE NEED HELP!

Job Assignment

每週固定討論

1. 每週六晚上18:00
2. 台大社科院研究室

會議結束前總結

1. 總結所有項目目前進行的程度
2. 列出下週須完成的項目

分配工作

按照專業領域分工

問題討論

- 週間進行的過程遇到任何問題：
1. 臨時開會
 2. 互相幫忙

Trello

利用trello追蹤每項工作進度