

Themenvorschläge für Bachelorarbeiten

1. Projekte mit SOEP-Daten

a) Schätzung der Partizipationswahrscheinlichkeit

empirische Analyse der Arbeitsangebotsfaktoren, d.h. welche Faktoren bestimmen, ob jemand Arbeit anbietet

Standardschätzung unter Verwendung von Probit bzw. Logit-Schätzung

Literatur: Wooldridge, J. (2006), Introductory Econometrics, Kap. 17

b) Schätzung der Lohnangebotsfunktion

Schätzung der Lohnangebotsfunktion unter Berücksichtigung der Nichtbeobachtbarkeit von Löhnen für Unbeschäftigte

Anwendung des Heckman-Schätzers bzw. doppelte Korrektur der Selektionsverzerrung nach Ham (1982)

Literatur: Wooldridge, J. (2006), Introductory Econometrics, Kap. 16 und 17

c) Schätzung der Arbeitsangebotsfunktion

Schätzung der Arbeitsangebotsfunktion unter Berücksichtigung, dass auch keine Arbeitsstunden angeboten werden können

Tobit-Schätzung, Anwendung des Heckman-Schätzers bzw. doppelte Korrektur der Selektionsverzerrung nach Ham (1982) auch möglich

Literatur: Wooldridge, J. (2006), Introductory Econometrics, Kap. 16 und 17

d) Schätzung von Panel-Logitmodellen

Empirische Analyse zur Ermittlung von Bestimmungsfaktoren für das Rauchen
Panel-Schätzung für Logitmodelle

Daten: SOEP-Daten für 2006 und 2008 (werden bereitgestellt)

Literatur: Wooldridge, J. (2010), Econometric analysis of cross-section and panel data, Kap. 15

2. Projekte zu simultanen Mehrgleichungssystemen/ IV-Schätzung

a) Zusammenhang von Inflation und Offenheit einer Volkswirtschaft

Schätzung des Einflusses der Offenheit auf Inflation unter Berücksichtigung der gleichzeitigen Kausalität von Inflation und Offenheit, Verwendung aktueller Daten

Anlehnung an simultanes Mehrgleichungssystem, IV-Schätzung

Literatur: Wooldridge, J. (2006), *Introductory Econometrics*, Kap. 16; Romer, D. (1993), *Openness and inflation: theory and evidence*, *Quarterly Journal of Economics*, 108: 869-903.

b) Test der permanenten Einkommenshypothese

Überprüfung der permanenten Einkommenshypothese unter Berücksichtigung von Endogenität

Anlehnung an simultanes Mehrgleichungssystem, IV-Schätzung unter Verwendung von verzögerten Variablen als Instrumente, eigene Datenrecherche

Literatur: Wooldridge, J. (2006), *Introductory Econometrics*, Kap. 16; Campbell, J.Y. und Mankiw, N.G. (1990), *Permanent income, current income, and consumption*, *Journal of Business and Economic Statistics*, 8: 265-279.

c) Schätzung einer Nachfragefunktion in der Luftfahrt

Schätzung einer Flugpassagier-Nachfragefunktion unter Berücksichtigung von Endogenität und individuellen Effekten

Anlehnung an simultanes Mehrgleichungssystem mit Panel Daten, gepoolte (Panel)-2SLS-Schätzung

Literatur: Wooldridge, J. (2006), *Introductory Econometrics*, Kap. 16; Aufgaben C9. Und C.10.

3. Projekt zu Paneldatenmodellen

a) Spezifikation und Schätzung eines Kostenmodell für Fluglinien

Spezifikation und Schätzung eines (Translog)kostenmodells für Fluglinien unter Berücksichtigung von individuellen Effekten

Panelschätzung und Translog-Modelle

Literatur: Greene, W. (2008), *Econometric Analysis*, 6ed., Kap.2 (S.13-14) Kap. 9 (Application 2, S. 250-251.) Kap. 10.4.2

4. Projekte zur Zeitreihenanalyse

a) Evaluation professioneller Konjunkturprognosen

Untersuchung und Vergleich der Prognosegüte verschiedener professioneller Konjunkturprognosen, wie z.B. des ZEWs und des IFO Instituts

Literatur: Enders, W. (2004), *Applied Econometric Time Series*, 2ed, Kap. 2 und Vorlesungsfolien von Frau Pigorsch

b) Spezifikation und Schätzung asymmetrischer GARCH-Modelle

Spezifikation und Schätzung asymmetrischer GARCH-Modelle wie z.B. Threshold-GARCH oder EGARCH, eigene Datenrecherche

Literatur: Tsay, R. (2002), *Analysis of Financial Time Series*, Kap. 3

c) Empirische Überprüfung des Random Walk Modells mit Hilfe von Mehrperiodenrenditen

Empirische Überprüfung des Random Walk Modells mit Hilfe von Mehrperiodenrenditen

Anwendung von Varianzverhältnistests und „long horizon regressions“

Literatur: Campbell, J. Y., Lo, A. W. and MacKinlay, A. G. (1997), *The Econometrics of Financial Markets*, Kap. 2

Fama E. und French, K. (1988), Permanent and temporary components of stock prices, *Journal of Political Economy*, 96: 246-273

d) Der Prognosegehalt von Dividendenrenditen für Aktienrenditen

Empirische Überprüfung des Prognosegehalts von Dividendenrenditen für Aktienrenditen

Anwendung von „long horizon regressions“ und direkten Prognosen, eigene Datenrecherche

Literatur: Campbell, J. Y., Lo, A. W. and MacKinlay, A. G. (1997), *The Econometrics of Financial Markets*, Kap. 7

Fama E. und French, K. (1988), Dividend yields and expected stock returns, *Journal of Financial Economics*, 22: 3-25

e) Kointegrationsanalyse der Ungedeckten Zinsparität

Überprüfung der Ungedeckten Zinsparität durch Kointegrationsanalyse der Zinsstrukturkurve

Anwendung von Einheitswurzeltests und des Engle-Granger Kointegrationstests auf internationale Zinsdaten

Literatur: Stock, J.H. und Watson, M.W. (2007), Introduction to Econometrics, Kap. 14 und 16; Brüggemann, R. und Lütkepohl, H. (2005), Uncovered interest rate parity and the expectations hypothesis of the term structure: empirical results for the U.S. and Europe, *Applied Economics Quarterly*, 51: 143-154.

f) Kointegrationsanalyse der Zinsstrukturkurve

Überprüfung der Erwartungswerthypothese durch Kointegrationsanalyse der Zinsstrukturkurve

Anwendung von Einheitswurzeltests und des Engle-Granger Kointegrationstests auf nationale Zinsdaten

Literatur: Stock, J.H. und Watson, M.W. (2007), Introduction to Econometrics, Kap. 14 und 16; Brüggemann, R. und Lütkepohl, H. (2005), Uncovered interest rate parity and the expectations hypothesis of the term structure: empirical results for the U.S. and Europe, *Applied Economics Quarterly*, 51: 143-154.

g) Kointegrationsanalyse der „forward rate unbiasedness hypothesis“

Überprüfung der „forward rate unbiasedness hypothesis“ für aktuelle Wechselkursdaten verschiedener Frequenz

Anwendung von Einheitswurzeltests und des Engle-Granger Kointegrationstests auf Wechselkursdaten, eigene Datenrecherche

Literatur: Stock, J.H. und Watson, M.W. (2007), Introduction to Econometrics, Kap. 14 und 16; Zivot, E. (2000), Cointegration and forward and spot exchange rate regressions, *Journal of International Money and Finance*, 19: 785-812.