

Ideen für Bachelorarbeitsthemen

Erbschaften und Konsum

Ändert sich nach einer Erbschaft der Konsum des Haushalts? Die Stärke der Änderung ist u.a. ein Indiz dafür, ob die Erbschaft bereits erwartet wurde. Die Untersuchung wäre vermutlich möglich mit EVS- oder HFCS-Daten.

Deskriptive Analyse der Reaktion reicher Steuerpflichtiger auf Steueränderungen.

Einfache Deskription mit Hilfe der Taxpayer-Panel-Daten.

Einkommensverteilung in Deutschland unter Berücksichtigung von Wohnkosten

Verwendung von SOEP-Daten, evtl. auch Daten der EVS. Siehe Moretti, 2013.

Entwicklung der Wohnkosten

Empirische Untersuchungen zum Anteil der Wohnkosten am Haushaltsbudget im Laufe der Zeit, z.B. mit Hilfe von Mikrozensus- Daten.

Zeitzone und Wertpapierbörsen

Haben asynchrone Sommer-/Winterzeitumstellungen an zwei Börsen einen Einfluss auf die Rendite-Korrelation von Wertpapieren, die an beiden Börsen gehandelt werden?

LASSO

Auswertung der LASSO-Schätzergebnisse bei (ko)integrierten Daten oder GARCH-Effekten durch Monte-Carlo-Simulationen.

Studiengebühren und Lohnverteilung

Gibt es in einem internationalen Vergleich mehrerer Länder einen Zusammenhang zwischen der Lohnverteilung und Studiengebühren? VAR-Analyse mit Kausalitätstest auf Grundlage internationaler Daten. Ein Problem könnte die Datenlage sein.

Sind subjektiv erwartete Einkommensschwankungen autoregressiv?

Hängen subjektiv erwartete Varianzen des Einkommens von (quadrierten) zurückliegenden Einkommensschocks ab? Mögliche Datenquelle: NBER Survey of Economic Expectations, siehe auch Literatur zu "income uncertainty".

Arbeitsdauer und Lohnhöhe

Wie sieht der empirische Zusammenhang zwischen der Lohnhöhe und der Arbeitsdauer (z.B. Stunden/Woche) aus? Einfache nichtparametrische Deskription geeigneter Daten, ohne den Versuch, einen kausalen Zusammenhang herzustellen.

Ideen für Masterarbeitsthemen

Strukturelle Mikrosimulationen

Einsatz von Reinforcement-Learning-Verfahren für die Mikrosimulation.

Renditemodellierung

Modellierung von Renditezeitreihen durch eine Student-t-Verteilung mit zeitvariabler latenter Zahl von Freiheitsgraden (und konstantem oder zeitvariablem Skalenparameter). Die Zahl der Freiheitsgrade wird wie im Standardmodell mit stochastischer Volatilität als AR(1)-Prozess modelliert.

Fehlspezifizierte Zustandsraum-Modelle

Systematische Untersuchung des Spezifikationsfehlers eines Zustandsraum-Modells mit Random-Walk-Koeffizienten, wenn das wahre Modell AR(1)-Koeffizienten hat. Analyse durch Monte-Carlo-Simulationen.

Vorhersagemodelle für Rohstoffpreise

z.B. mit LASSO und anderen Machine-Learning-Ansätzen.

Bildung und Konjunkturschocks

Können Konjunkturschocks als Instrumente zur Schätzung der Bildungsrendite dienen? Idee: Eine Rezession führt zu mehr Bildung, weil die Schulabgänger keinen Arbeitsplatz finden. Die bessere Bildung schlägt sich später in einer höheren Bildungsrendite nieder.

Multivariate Dichteprognose

Einsatz der PIT für Linearkombinationen. Durch Linearkombinationen geht man vom Multivariaten ins Univariate. Wenn die multivariate Spezifikation stimmt, müssen alle Linearkombinationen i.i.d. $[0,1]$ -verteilte PITs ergeben.

Einkommensmobilität

Gibt es eine Verbindung zwischen der Eppstein-Zin-Nutzenfunktion und der Einkommensmobilitätsmessung?