



Aufgabenstellung zu einer Bachelorarbeit

Name, Vorname: Credé, Andreas
Matrikelnummer: 4704513
Studiengang: Finanz- und Wirtschaftsmathematik

Thema der Bachelorarbeit:

Auswirkungen von Meldungen in sozialen Medien auf Aktienmärkte
Impact of social media announcements on stock markets


Beginn: 28.11.2019

Abgabe: 28.02.2020

Als Zweitprüfer wird Herr Prof. Dr. Jens-Peter Kreiß benannt.

Offensichtlich haben soziale Medien heutzutage erheblichen Einfluss auf verschiedene Bereiche des Lebens. Daraus resultiert aus finanzwirtschaftlicher Sicht unmittelbar die Frage, ob soziale Medien auch Einfluss auf den Kapitalmarkt haben. In diesem Kontext erörtert inzwischen bereits eine Vielzahl wissenschaftlicher Beiträge die Auswirkungen von (insbesondere international bedeutenden) Berichterstattungen in sozialen Medien auf Aktienmärkte. Das Ziel der Berücksichtigung solcher Einflussfaktoren liegt in einer Verbesserung bestehender Regressionsmodelle und daraus resultierend einer verbesserten Aktienkursprognose.

Im Rahmen seiner Bachelorarbeit erhält Herr Credé die Aufgabe, Auswirkungen von Meldungen in sozialen Medien auf die Aktienmarktentwicklungen zu untersuchen und für ein Prognosemodell zu verwenden. Dabei soll zunächst ein Überblick zu bereits bestehenden Untersuchungen in der Literatur gegeben werden. Hierbei ist insbesondere die im jeweiligen Literaturbeitrag verwendete Methode zur Identifikation von kursrelevanten Informationen vorzustellen und auf die Prognosegüte des resultierenden Modells einzugehen. Anschließend soll Herr Credé auf Basis der Literaturergebnisse (in Abstimmung mit dem Institut für Finanzwirtschaft) eigenständig eine Variable konstruieren, die als Repräsentant für die Stimmungslage am Kapitalmarkt dienen soll. Diese Variable soll zusammen mit weiteren marktbeeinflussenden Variablen im Rahmen eines Regressionsmodells genutzt werden, Aktienmarktentwicklungen zu prognostizieren. Abschließend ist die Prognosegüte des resultierenden Modells zu beurteilen.



Prof. Dr. Marc Gürtler