

Inhaltsübersicht

1. Einleitung	1
2. Grundlagen der Disparitätsmessung	5
3. Normierte inverse Verteilungsfunktion, Lorenzkurve und verallgemeinerte Lorenzkurve	13
4. Der Gini-Koeffizient und einige seiner Anwendungsbereiche	25
5. Ein alternativer Ansatz zur Lorenzkurve und zum Gini-Koeffizienten: Der Vorschlag von ZENGA zur Disparitätsmessung	73
6. Aus der normierten inversen Verteilungsfunktion abgeleitete Maße	81
7. Kumulierte Lorenzkurven, daraus abgeleitete Disparitätsmaße und deren Verallgemeinerung	103
8. Die Korrelations-Lorenzkurven und einige Anwendungsmöglichkeiten	125
9. Die Lorenzkurve und partielle Ordnungsrelationen	171
10. Abschließende Bemerkungen	219
Anhang	221
Literaturverzeichnis	229

Inhaltsverzeichnis

1. Einleitung	1
1.1 Problemstellung und Zielsetzung der Arbeit	1
1.2 Aufbau der Arbeit	2
2. Grundlagen der Disparitätsmessung	5
2.1 Grundbegriffe und allgemeine einführende Überlegungen	5
2.2 Von Disparitätsmaßen geforderte Eigenschaften	7
3. Normierte inverse Verteilungsfunktion, Lorenzkurve und verallgemeinerte Lorenzkurve	13
3.1 Die normierte inverse Verteilungsfunktion	13
3.2 Die Lorenzkurve	15
3.2.1 Interpretationsmöglichkeiten der Lorenzkurve aus formaler Sicht	15
3.2.2 Die Lorenzkurve als Disparitätsindikator	18
3.2.3 Anwendungsbeispiele der Lorenzkurve	20
3.3 Die verallgemeinerte Lorenzkurve von SHORROCKS	23
4. Der Gini-Koeffizient und einige seiner Anwendungsbereiche	25
4.1 Verschiedene Darstellungsformen und daraus ableitbare Grenzen von R	27
4.2 Der Gini-Koeffizient als Disparitätsmaß	35
4.2.1 Der Gini-Koeffizient vor dem Hintergrund von Mittelwerten von Ordnungsstatistiken	36
4.2.1.1 Mittelwerte von Ordnungsstatistiken: Grundlegende Begriffe	36
4.2.1.2 Interpretation des Gini-Koeffizienten vor dem Hintergrund von Mittelwerten von Ordnungsstatistiken	42
4.2.2 Der Gini-Koeffizient im Vergleich mit V^2 und $V^2/1+V^2$	48
4.3 Der Gini-Koeffizient als Baustein eines Konzentrationsmaßes	52
4.4 Der Gini-Koeffizient als Baustein eines Asymmetrie- und eines Wölbungsmaßes	54
4.5 Der Gini-Koeffizient als Baustein von Armuts- und Überflußmaßen	58
4.6 Der Gini-Koeffizient bei der Messung von Preisvektoren-Distanzen	60

4.7 Die Sektorenaggregations-Darstellung des Gini-Koeffizienten und spezielle Anwendungsmöglichkeiten	62
4.7.1 Prüfung von Eigenschaften des Disparitätsmaßes R	66
4.7.2 Die Rekursionsform von R	66
4.7.3 Die Verwendung von R im Rahmen der Ungleichheitsmessung zwischen zwei Verteilungen	68
4.7.4 Die Verwendung von R im Rahmen der Dominanzmessung	70
5. Ein alternativer Ansatz zur Lorenzkurve und zum Gini-Koeffizienten: Der Vorschlag von ZENGA zur Disparitätsmessung	73
6. Aus der normierten inversen Verteilungsfunktion abgeleitete Kurvenzüge	81
6.1 Die "Adaptierte Lorenzkurve"	82
6.2 Die Gegenkurve zur "Adaptierten Lorenzkurve"	86
6.3 Die "Lückenkurve"	89
6.4 Interpretationsmöglichkeiten dieser Kurven vor verschiedenen Anwendungshintergründen	93
7. Kumulierte Lorenzkurven, daraus abgeleitete Disparitätsmaße und deren Verallgemeinerung	103
7.1 Von unten kumulierte Lorenzkurven	103
7.2 Von oben kumulierte Lorenzkurven	113
7.3 Der allgemeine Disparitätsindex I von PIESCH und MEHRAN	120
8. Die Korrelations-Lorenzkurven und einige Anwendungsmöglichkeiten	125
8.1 Grundbegriffe und zwei wesentliche Theoreme	125
8.2 Variablenaggregation und Interpretationsmöglichkeiten einzelner Komponenten	135
8.3 Ausgewählte Anwendungsbereiche der Korrelations-Lorenzkurven	144
8.3.1 Lorenzkurven höherer Momente und deren Anwendungsmöglichkeiten	145
8.3.2 Die Varianz-Korrelations-Lorenzkurve	152
8.3.3 Die Bayes-Korrelations-Lorenzkurve	155
8.3.4 Anwendung im Rahmen der Portfolio-Analyse	155
8.3.5 Anwendung vor finanzwissenschaftlichem Hintergrund: Verteilungswirkungen von Einkommensteuertarifen	158
8.3.6 Anwendung im Rahmen der Segregationsanalyse	166

9. Die Lorenzkurve vor dem Hintergrund partieller Ordnungsrelationen	171
9.1 Einige allgemeine Zusammenhänge zwischen Ordnungsrelationen	172
9.2 Überblick über bekannte Ordnungsrelationen	174
und deren Bezüge zur Lorenzkurve	
9.2.1 Die stochastische Dominanzordnung und deren Bezüge zur Lorenzkurve	177
9.2.2 Inverse stochastische Dominanz und deren Bezüge zur Lorenzkurve	181
9.2.3 Verhältnis-Dominanz und deren Bezüge zur Lorenzkurve	182
9.2.4 Inverse Verhältnis-Dominanz und deren Bezüge zur Lorenzkurve	184
9.2.5 Eine zusammenfassende Übersicht	188
9.3 Die Lorenz-Dominanzordnung	189
9.3.1 Äquivalente Darstellungsformen zur Lorenz-Dominanzordnung	189
9.3.2 Lorenz-Dominanz erzeugende und erhaltende Transformationen	192
9.3.3 Lorenz-Dominanz bei Aggregation und Mischung von Verteilungen	194
9.4 Die Bedeutung verschiedener Ordnungsrelationen für die Disparitätsmessung	197
9.4.1 Die Lorenz-Dominanzordnung und Ungleichheitsindizes	197
9.4.2 Die Bedeutung der Starshaped-Ordnung für die Ungleichheitsmessung	200
9.4.3 Inverse stochastische Dominanz, Dominanz der kumulierten Lorenzkurven	201
und Ungleichheitsmessung	
9.5 Streuungs- und Ungleichheitsordnungen im Vergleich	204
9.6 Partielle Ordnungen im Rahmen der Analyse von Lebensdauerverteilungen	209
und deren Bezüge zur Lorenzkurve	
9.6.1 Wesentliche Zusammenhänge in einer Übersicht	210
9.6.2 Bezüge wichtiger Ordnungsrelationen zur Lorenzkurve	213
9.7 Anwendung bei der Beurteilung risikobehafteter Anlageformen	215
10. Abschließende Bemerkungen	219
Anhang	221
Literaturverzeichnis	229