

# Stichwortverzeichnis

## **a**

Ablenkungsfaller 78  
Ad-hoc-Hypothese 381  
Äquivalenzziffern 208  
Äquivalenzziffernrechnung 208  
Agenten 118  
Agentenbasierte Simulation 45, 117  
Akzeptanzfaller 78, 84  
Analogien 78  
Analogietechniken 35  
Ankerheuristik 155  
Anpassungsheuristik 155  
Arbitrage-Effekte 203  
Astragali 30

## **b**

Bachelier, Louis 107  
Balanced Scorecard 42, 245  
Balancing loops 127  
Bernoulli-Verteilung 262  
Best-Case-Szenario 169  
Bestands- und Flussgrößen-Diagramme 378  
Bestandsgröße 381  
Betaverteilung 262  
Binomialverteilung 108, 262  
Black Swan 51, 60, 150  
Blackbox 84  
Bohr, Niels Henrik David 25  
Brainstorming 35, 196  
Brainwriting 35  
Bullwhip-Effekt 122

## **c**

Captive 203  
Cash-Flow-Rechnungen 264  
Cauchy-Verteilung 262

Causal Loop Diagram 128  
Chance 28  
Chi-Quadrat-Verteilung 262  
Cholesky-Zerlegung 109  
Club of Rome 17, 125  
constants 127  
Controlling 264  
Cross-Impact-Analysen 35  
Cumulative distribution function 273

## **d**

Delphi-Methode 33, 35  
Deterministisches Modell 112  
Diskrete ereignisorientierte Simulation  
III  
Downside-Risiko 275  
Dreiecksverteilung 108  
Dynamic Financial Analysis 49, 58

## **e**

EBIT-at-Risk 106  
Eigenkapital 260  
Einflussfaktoren 183  
Einflussfaktorenanalyse 96  
Eintrittswahrscheinlichkeit 147  
Emergenzen 122  
Emerging Risk 153  
Emerging Risk Management 154  
Enterprise Risk Management 156  
Entscheidungsunterstützung 69  
Ereignisdiskrete Simulation 307  
ERM 156  
Expected Shortfall 296  
Exponentialverteilung 108, 262

## **f**

Falsifikationismus-Prinzip 51  
Feedback loops 127

Feedbackstruktur 378  
Fisher-Verteilung 262  
Forrester, Jay W. 17, 124, 372  
Fortuna 26  
Framing 155

## **g**

Gammaverteilung 262  
Geometrische Verteilung 262  
Gleichverteilung 108, 262  
Group Model Building 391

## **h**

Heatmap-Assessment 196  
Heuristik 381  
Höhlengleichnis 16  
Hypergeometrische Verteilung 262  
Hypothesentest 317

## **i**

Idon-Sechseck-Technik 375  
Innovations- und Diffusionsanalysen  
35  
Input 126  
Input-Output-Modelle 35  
Interpretationsfälle 78, 82  
Inverse cumulative distribution  
function 273  
Inverse Verteilungsfunktion 273  
Ishikawa-Diagrammtechnik 375

## **k**

Kahn, Herman 16, 94  
Kalibrierung 123  
Komplexität 38, 96, 124, 149, 153,  
209, 371  
Komplexitätsfälle 78, 80, 100  
Konfidenzniveau 294  
Konfliktsimulation 52  
Konvergenzgenerator 108  
Korrelationen 109  
Korrelationskoeffizient 301  
Kosten-Nutzen-Relation 70  
Kostenrechnung 92, 205  
Kumulkontrolle 149, 199  
Kumulrisiken 149  
Kumulzenario 152  
Kybernetik 32

## **l**

Level 127  
Log-Normalverteilung 262  
Logarithmische Verteilung 262  
Logistische Verteilung 262  
Lorentz-Verteilung 262

## **m**

Makroebene 119  
Manhattan-Projekt 101  
Markteintrittsszenarien 139  
Massachusetts Institute of Technology  
124  
Meadows, Dennis L. 17, 34  
Metaheuristiken 364  
Mikroebene 119  
Mind Mapping 375  
Modell 64, 72  
Modellkonzept 75  
Modifizierbarkeit 49  
Monte-Carlo-Simulation 45, 52, 101,  
205, 263  
More, Thomas 32  
Morphologische Methoden 35  
Multivariate Verteilungsfunktionen  
262

## **n**

Neumann, John von 101, 117  
Newsvendor-Modell 107  
Nichtlinearitäten 128  
Normalverteilung 108, 262

## **o**

Ökonometrie 127  
Operations Research 45  
Orakel 26, 31  
Output 126  
Overconfidence 155

## **p**

Papiercomputer 96  
Parameter 60, 127  
Pareto-Verteilung 262  
Pascal-Verteilung 262  
Personalplanung 225  
PERT-Verteilung 280  
Planspiel 244

Platon 16  
Poisson-Verteilung 262  
Popper, Sir Karl Raimund 51  
Portfolio-Modelle 156  
Pragmatismus 64  
Probability density function 273  
Produkt-Moment-Korrelation 301  
Prognose 50  
Prototyping 82

## r

RAND Corporation 33  
Rangkorrelationskoeffizient 302  
RAROC 298  
Rationalität 28  
Realistic-Case-Szenario 169  
Realitätsausschnitt 73  
Realoptionen 42  
Referenz-Zeitverlaufs-Diagramme 376  
Regelkreis 72  
Reinforcing loops 127  
Relevanzbaumverfahren 35  
Reproduzierbarkeit 49  
Resilienz 156  
Reverse Stresstesting 194  
Review-Preview-Szenario-Denken 195  
Risiko 28, 149  
Risikoaggregation 106, 260  
Risikokapital 106  
Risikomanagement 124, 149, 256  
Risikomaß 294  
Risikostrategie 193  
Risikotragfähigkeit 259 f.  
Rollenspiele 35  
RORAC 297  
Rückversicherung 147  
Ruinwahrscheinlichkeit 294, 296

## s

Schwarzer Schwan 51  
Sensitivitätsanalyse 213, 300  
Sensitivitätstyp 301  
Sicherheitsniveau 265  
Simulation 42, 55, 285  
Simulationsexperimente 76  
Simulationsfähigkeit 68  
Simulationsmethode 37, 67 f., 87  
Simulationsmodell 49, 53, 74, 373  
Simulationstechnik 50

Spearman'sche Rangkorrelation 301  
Spieltheorie 45  
Stabilitätsanalyse 106  
Standardabweichung 212  
Stochastische Planung 107, 259  
Stochastische Simulation 147  
Stock and Flow Diagram 128  
Stressszenario 286  
Stresstesting 194  
Streuung 212  
Studentische t-Verteilung 262  
Studie 39  
Supply Chain 122, 158  
System Dynamics 34, 45, 124, 225, 371  
Szenariengenerator 266  
Szenario 15, 33, 61, 164  
Szenario-Planung 106, 256  
Szenarioanalyse 34, 58, 63, 94, 147, 176, 256, 371  
Szenariobildung 94  
Szenariotrichter 100

## t

Tail Value at Risk 296  
Taleb, Nassim N. 50  
Trendanalyse 35  
Trendextrapolation 35  
Trunkierung 277

## u

Ulam, Stanislaw 117  
Umsetzungsfälle 78, 81  
Unsicherheit 148  
Unternehmensführung,  
risikoorientiert 261  
Unternehmenssteuerung 15  
Upside-Risiko 275  
Ursache-Wirkungseffekt 126  
Utopia 32

## v

Validierung 353  
Validität 65  
Value at Risk 106, 293  
Varianz 301  
Verfügbarkeitsheuristik 156  
Vernetzungsmatrix 96  
Verteilung 214  
Verteilungsfunktion 273

**w**

Wahrscheinlichkeitsdichte 109, 273  
Wahrscheinlichkeitstheorie 28  
Wargaming 28, 45, 52, 75, 134, 236  
Was-wäre-wenn-Analyse 56, 68, 90  
Weibull-Verteilung 262  
Wertschöpfungskette 122  
Wiener, Anthony J. 94  
Wirkungsverzögerungen 128  
World3 17, 34, 125  
Worst-Case-Szenario 169

**z**

Zielgröße 58  
Zufallszahl 103, 273  
Zufallszahlengenerator 108  
Zukunft 25  
Zukunftswerkstatt 35  
Zustandsvariablen 127