

wählt werden. Sie sind auch als Themen für ein Proseminar geeignet. Eine Übersicht über die Abhängigkeit der einzelnen Kapitel findet sich auf Seite VII.

Dieser Text ist aus Vorlesungen entstanden und ich danke meinen Studenten, Schülern und Kollegen für ihr Interesse und ihre Mitarbeit. Namentlich erwähnen möchte ich Dr. Björn Böttcher und Dr. Franziska Kühn, die den gesamten Text der ersten Auflage kritisch durchgesehen und viele Verbesserungen vorgeschlagen haben; Herr Böttcher hat außerdem viele Illustrationen erstellt. Prof. Niels Jacob, Dr. Katharina Fischer und Dr. Georg Berschneider verdanke ich viele hilfreiche Hinweise. Die zahlreichen Änderungen der zweiten Auflage wurden von Herrn Dr. David Berger und Dr. Robert Baumgarth gegengelesen.

Die Zusammenarbeit mit dem Verlag de Gruyter, allen voran Frau Schedensack und Herrn Horn, war sehr angenehm und hat wesentlich zum Gelingen dieses Buchs beigetragen. Meiner Frau danke ich für ihre Geduld, die sie o.B.d.A. (»ohne Beschränkung deiner Arbeitszeit«) immer wieder für meine Buchprojekte aufbringt.

Dresden, Januar 2025

René L. Schilling

Mathematische Grundlagen

Für die Lektüre dieses Texts werden Grundlagen der Maß- und Integrationstheorie benötigt, etwa im Umfang von Kapitel 1–16 meines in der gleichen Reihe erschienenen Lehrbuchs *Maß und Integral*. Ein Kurs über elementare Wahrscheinlichkeitstheorie wird nicht vorausgesetzt, viele abstrakte Konzepte versteht man aber besser, wenn man die diskreten Grundlagen kennt und eine Intuition für die Sprech- und Denkweisen der Stochastik entwickelt.

Maß- und Integrationstheorie

Schilling, R.L.: *Maß und Integral*. De Gruyter, Berlin 2024² (zitiert als [MI]).

Schilling, R.L.: *Measures, Integrals and Martingales*. Cambridge University Press, Cambridge 2017² (zitiert als MIMS).

Elementare Wahrscheinlichkeitstheorie

Bosch, K.: *Elementare Einführung in die Wahrscheinlichkeitsrechnung*. Vieweg+Teubner, Wiesbaden 2014⁸.

Chung, K.L., Ait Sahlia, F.: *Elementary Probability Theory*. Springer, New York 2003⁴.

Gorroochurn, P.: *Classic Problems of Probability*. Wiley, Hoboken (NJ) 2012.

Grimmett, G., Welsh, D.: *Probability. An Introduction*. Oxford Univ. Press, Oxford 2014².

Haigh, J.: *Probability Models*. Springer, London 2013².

Haller, R., Barth, F.: *Berühmte Aufgaben der Stochastik*. De Gruyter, Berlin 2016².

Krengel, U.: *Einführung in die Wahrscheinlichkeitstheorie und Statistik*. Vieweg, Wiesbaden 2007⁸.