

狄拉克δ函数:在除了零以外的点函数值都等于零，而其在整个定义域上的积分等于1。

若一个随机过程 $\{X(t), t \geq 0\}$ 满足：

- 1. $X(t)$ 是独立增量过程；
- 2.任意 $s, t > 0$,

，即 是期望为0，方差为 的正态分布；

- 3. $X(t)$ 关于 t 是连续函数。

则称 $\{X(t), t \geq 0\}$ 是**维纳过程**（Wiener process）或布朗运动。

独立增量过程:如果对于任意的参数 ，随机变量 相互独立，则称它是独立增量过程。

维纳过程具有**马尔可夫性质**，也就是说，在任意一点之后的走势仅仅和这一点的取值相关，而与之之前的取值无关。

这种已知“现在”的条件下，“将来”与“过去”无关的特性称为马尔可夫性.

强马尔可夫过程(strong Markov process)是一类随机过程，指具有比马尔可夫性更强的条件无后效性的随机过程.

停时

(delta)
(sigma)