

Канонические разложения

Центрированная СВ (опр)

Элементарно центрированная СВ (опр)

Хар-ки (Математическое ожидание, Коррелированная функция., Дисперсия, Стандартное отклонение, коэффициент корреляции)

Каноническое разложение СП (опр)

Хар-ки (Математическое ожидание, Коррелированная функция., Дисперсия, Стандартное отклонение, коэффициент корреляции)

Замечание

Понятие обобщенной функции дельта-функции Дирака. Белый шум и его свойства.

обобщенная функция (опр)

дельта функция Дирака (опр + фор + рис)

Свойства 1-2-3

Нестационарный белый шум + стационарный белый шум (опр)

основное свойство стационарного шума

Канонические интегральные представления СП

Канонические интегральные представления СП (опр)

характеристики СП: (Математическое ожидание, коррелированная функция, дисперсия, стандартное отклонение, коэффициент корреляции, плотность дисперсии)

Линейные и нелинейные преобразования СП

Постановка задачи

Прямая, обратная, оптимизационные задачи

Операторы (рис)

Задача о преобразовании СП неоднородного оператора систем

характеристики: (Математическое ожидание, коррелированная функция, дисперсия, стандартное отклонение, коэффициент корреляции)

Квадратичный детектор

Постановка задачи и решение

Векторные СП

Опр

МО ВСП

Квадратная матрица корр функций

Комплексные СП

МО

Коррелированная функция (доказательство)

Дисперсия

