



■ 随机过程的统计特性

DX = ELX*] - E*X

方差

D[ξ(t)] = E{[ξ(t) - a(t)]²} = E[ξ²(t)] - a²

随机过程的方差表示了随机过程ξ(t) 在 t 时刻偏离数学

复习: 随机变量方差的性质

D[C] = 0 常数的方差是0;

D[CX] = C²D[X], D[X+C] = D[X]

对于两个随机变量 X₁, X₂, 有

 $B(t_1, x)$ 对于零均值随机过程 $t_2-t_1=t_1$ 假定 $t_2>t_1$,令 $t_2=t_1+\tau$ 我们一般研究时间间隔