* K-L展开式系数的计算步骤

K-L展开式系数可如下求得：

* 1. 求随机向量x的自相关矩阵：R = E{xxT}
  2. 求出矩阵R的特征值λj和对应的特征向量φj，j = 1,2,…,n，得矩阵：



* 1. 计算展开式系数：

a = ΦTx