

Лабораторная работа №4

Случайные процессы

Реализовать программу генерации стационарного СП с заданной автокорреляционной функцией $K(\tau)$. Сгенерировать реализацию (реализации) СП и провести подходящее (правильное) исследование различных характеристик СП. По возможности продемонстрировать с помощью графиков.

Варианты

$$1 - K(\tau) = De^{-\alpha|\tau|}(1 + \alpha|\tau|)$$

$$2 - K(\tau) = De^{-\alpha|\tau|}(1 - \alpha|\tau|)$$

$$3 - K(\tau) = De^{-\alpha|\tau|} \left(1 + \alpha|\tau| + \frac{\alpha^2 \tau^2}{3} \right)$$