

引入

- 状态空间的两个重要例子:

1. 隐马尔可夫模型, 其中: 潜在变量是离散的.

2. 线性动态系统: 潜在变量高斯

静态分布

- 静态分布中, 数据会随着时间的发生改变, 但是生成数据的根元分布保持不变;

非静态分布

- 生成根元本身会随时间变化.

- 处理顺序数据最简单的方式是忽略顺序的性质, 将观测看作独立同分布;

- 但这样我们得到唯一信息是事情发生的频率,

- 有些数据呈现趋势性(天气).

若

- $$P(x_1, \dots, x_N) = P(c_1) \prod_{n=2}^N P(c_n | c_1, \dots, c_{n-1})$$



