

## 可分离随机过程的新息与滤波

杜金观, 潘一民

中国科学院应用数学研究所

收稿日期 1978-11-15 修回日期 网络版发布日期 接受日期

**摘要** 本文定义了连续时间二阶随机过程的某种可分离性,给出了这类过程的新息过程所满足的关系式,并且证明了它们与“白噪声”作用下的线性系统的输出过程等价.

又给出了一类与上述过程具有某种可分离性的随机向量的最佳线性估计.作为应用,严格地推导了两种线性系统的新息、滤波、预报和平滑所满足的随机微分方程.

**关键词**

**分类号**

**Abstract**

**Key words**

DOI:

通讯作者

### 扩展功能

#### 本文信息

- ▶ [Supporting info](#)
- ▶ [PDF\(0KB\)](#)
- ▶ [\[HTML全文\]\(0KB\)](#)
- ▶ [参考文献](#)

#### 服务与反馈

- ▶ [把本文推荐给朋友](#)
- ▶ [加入我的书架](#)
- ▶ [加入引用管理器](#)
- ▶ [复制索引](#)
- ▶ [Email Alert](#)
- ▶ [文章反馈](#)
- ▶ [浏览反馈信息](#)

#### 相关信息

- ▶ [本刊中 无 相关文章](#)
- ▶ 本文作者相关文章
  - [杜金观](#)
  - [潘一民](#)