

论文与报告

## 广义离散随机线性系统最优递推预报方法及其渐近稳定性

张焕水,柴天佑

东北大学自动化研究中心,沈阳

收稿日期 1995-2-4 修回日期 网络版发布日期 接受日期

摘要

讨论广义离散随机线性系统最优状态估计问题,运用新息理论和射影的方法提出了广义离散随机线性系统最优递推预报器和滤波器,证明了递推预报器对于初始值的选取渐近稳定.

关键词 [广义离散随机线性系统](#) [最优递推预报器](#) [滤波器](#) [稳定性](#)

分类号

## The Optimal Recursive Predicting Method for the Singular Discrete Stochastic System and its Asymptotic Stability

Zhang Huanshui, Chai Tianyou

Research Center of Automation, Northeastern University, Shenyang

Abstract

This paper deals with the optimal state estimation for the singular discrete stochastic linear system. The optimal recursive predictor and the optimal filter for the singular discrete stochastic linear system are presented by using the innovation theory and projection method, and the asymptotic stability of the optimal predictor is proved .

Key words [Singular discrete stochastic linear system](#) [optimal recursive predictor](#) [filter](#) [stability](#)

DOI:

通讯作者

作者个人主页 张焕水;柴天佑

### 扩展功能

本文信息

▶ [Supporting info](#)

▶ [PDF\(453KB\)](#)

▶ [\[HTML全文\]\(0KB\)](#)

▶ [参考文献\[PDF\]](#)

▶ [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 包含“广义离散随机线性系统”的 相关文章](#)

▶ 本文作者相关文章

· [张焕水](#)

· [柴天佑](#)