

В.А. ФУРСОВ

**ИДЕНТИФИКАЦИЯ СИСТЕМ
ПО МАЛОМУ ЧИСЛУ
НАБЛЮДЕНИЙ**

2007



САМАРА

ФЕДЕРАЛЬНОЕ АГЕНТСТВО ПО ОБРАЗОВАНИЮ
ГОСУДАРСТВЕННОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ УЧРЕЖДЕНИЕ
ВЫСШЕГО ПРОФЕССИОНАЛЬНОГО ОБРАЗОВАНИЯ
«САМАРСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ АЭРОКОСМИЧЕСКИЙ
УНИВЕРСИТЕТ имени академика С.П. КОРОЛЕВА»

В.А. ФУРСОВ

ИДЕНТИФИКАЦИЯ СИСТЕМ ПО МАЛОМУ ЧИСЛУ НАБЛЮДЕНИЙ

*Утверждено Редакционно-издательским советом
в качестве учебного пособия*

С А М А Р А
Издательство СГАУ
2007

УДК 004.9(075)
ББК 39.87
Ф 954



**Инновационная образовательная программа
«Развитие центра компетенции и подготовка
специалистов мирового уровня в области аэро-
космических и геоинформационных технологий»**

Рецензенты: д-р физ.-мат. наук А. И. Жданов,
д-р физ.-мат. наук В. М. Чернов

Фурсов В.А.

Ф 954 **Идентификация систем по малому числу наблюдений: учеб. пособие** / В.А.Фурсов – Самара: Самар. гос. аэрокосм. ун-т. 2007. – 80 с.: ил.

ISBN 978-5-7883-0626-1

В учебном пособии рассматриваются сравнительно новые подходы к построению оценок параметров систем в условиях неопределенности, связанной с малым числом наблюдений. Развиваемый подход основан на нетрадиционных предположениях, связанных с тем, что при малом числе наблюдений статистическая информация ненадежна либо отсутствует. Изучаются методы контроля информативности малых наборов данных. Приводятся алгоритмы оценивания, работоспособные в условиях статистической неопределенности.

Подготовлено и издано при финансовой поддержке Министерства образования и науки РФ, Администрации Самарской области и Американского фонда гражданских исследований и развития (CRDF).

УДК 004.9(075)
ББК 39.87

ISBN 978-5-7883-0626-1

© В.А. Фурсов, 2007
© Самарский государственный
аэрокосмический университет, 2007