**Кондратьева, Елена Владиславовна.**

## Фильтр типа Калмана-Бьюси в случае вырождения шумов в наблюдениях : диссертация ... кандидата физико-математических наук : 01.01.09. - Ленинград, 1983. - 97 с. : ил.

## Оглавление диссертациикандидат физико-математических наук Кондратьева, Елена Владиславовна

ВВЕДЕНИЕ.

1. Актуальность проблемы, основные результаты исследований.

2. Общий анализ литературы по теме исследований

3. Обсуждение результатов, полученных в диссертационной работе.

ГЛАВА I. ЗАДАЧИ ЛИНЕЙНОЙ ФИЛЬТРАЦИИ.

§1.1. Основные понятия и определения. Задача фильтрации.

§1.2. Понятие решения. Существование и единственность решения стохастического дифференциального уравнения

§1.3. Интерпретация оптимальной линейной оценки

ГЛАВА 2. ГЕОМЕТРИЧЕСКИЙ МЕТОД ВЫВОДА УРАВНЕНИЙ ОПТИМАЛЬНОГО ЛИНЕЙНОГО ФИЛЬТРА ТИПА КАЛМАНА-БЫОСИ.

§2.1. Вывод уравнений для оптимальной оценки в дискретном случае

§2.2. Построение оптимального линейного фильтра для непрерывного времени

§2.3. Обоснование корректности предельного перехода

§2.4. Задача демпфирования вектора

ГЛАВА 3. ПОСТРОЕНИЕ ЛИНЕЙНЫХ ОПТИМАЛЬНЫХ ОЦЕНОК В СЛУЧАЕ,

КОГДА ШУМ В СИСТЕМЕ НАБЛЮДЕНИЙ - ВЫРОЖДЕННЫЙ

§3.1. Решение задачи фильтрации в случае вырождения шумов в наблюдениях для стационарных систем

§3.2. Pememie возмущенной задачи.

§3.3. Задача с вырождением как предельный случай возмущенной задачи

§3.4. Структура линейной оптимальной оценки в нестационарной задаче с вырожденным шумом наблюдений

§3.5. Аппроксимация нестационарной непрерывной задачи случаем кусочно-постоянных матриц

§3.6. Примеры наличия точек сгущения в множестве точек перемены рангов матриц