

Вопросы к разделу «Теория идентификации линейных стационарных динамических объектов»

1. Представление о методах идентификации. Общий алгоритм идентификации. Модели идентифицируемых объектов (включая ARX и ARMAX). Предсказатели.
2. Непараметрические методы идентификации: ковариационный анализ, частотные методы. Условия сходимости оценок.
3. Параметрические методы: минимизация ошибки предсказания и корреляционные методы. Оценка параметров ARX и ARMAX моделей. Условия сходимости и состоятельности.

Примечания:

Основной целью раздела состояла в ознакомлении с методами идентификации и условиями их применимости. Поэтому следует обратить основное внимание на идеи, лежащие в основе отдельных методов, и условия применимости этих методов. При ответе доказывать только те утверждения, что были доказаны на лекциях.

Литература:

1. Льюнг Л. Идентификация систем. Теория для пользователя: Пер. с англ. / Под ред. Цыпкина Я.З. – М.: Наука, ФИЗМАТЛИТ, 1991.