

Modelowanie i identyfikacja

Laboratorium nr 4

1. Zaimplementować następujące estymatory:
 - (a) estymator wartości oczekiwanej,
 - (b) estymator wariancji,
 - (c) estymator kowariancji,
 - (d) estymator korelacji.
2. Zbadać zachowanie estymatorów dla zmiennych losowych wygenerowanych z następujących rozkładów:
 - (a) normalnego,
 - (b) wykładniczego,
 - (c) Cauchy'ego.
3. Zbadać estymatory z wykorzystaniem następujących narzędzi, przy zmieniającej się liczbie próbek:
 - (a) błąd średniokwadratowy estymatora,
 - (b) zbieżność estymatora.