

# **SOLUCIÓN RECURSIVA PARA LOS PROBLEMAS DE ESTIMACIÓN LINEAL EN TIEMPO DISCRETO**

*R.M. Fernández-Alcalá, J. Navarro-Moreno, J.C. Ruiz-Molina, M.D. Estudillo*

Departamento de Estadística e Investigación Operativa  
Universidad de Jaén  
Emails: {rmfernan, jnavarro, jcruiz, mdestudi}@ujaen.es

## **RESUMEN**

Se introduce un algoritmo general de estimación lineal en tiempo discreto válido para los problemas de alisado, filtrado y predicción de una señal observada en presencia de ruido blanco aditivo correlado con la señal. El método de solución propuesto se basa en los desarrollos en series aproximados para procesos estocásticos y su principal ventaja es que proporciona una forma recursiva de cálculo para el estimador que puede ser aplicada sin la necesidad de imponer condiciones estructurales sobre las funciones de covarianzas implicadas.