

S-MSCKF 论文公式推导与代码解析

高洪臣

2019 年 9 月 1 日

目录

1	概述	2
1.1	MSCKF	2
1.2	MSCKF vs EKF-SLAM	2
1.3	S-MSCKF	2
2	Image Processor	3
2.1	Initialize	3
2.2	ImuCallback	3
2.3	StereoCallback	3
3	MsckfVio Estimator/Filter	4
3.1	Kalman Filter Overview	4
3.2	代码流程	4
3.2.1	Initialize	4
3.2.2	ImuCallback	4
3.2.3	FeatureCallback	4
3.3	EKF 状态向量	6
3.4	Propagation/Prediction	6
3.4.1	IMU 误差状态方程	6
3.4.2	IMU 状态向量预测	7
3.4.3	系统状态协方差预测	7
3.5	State Augmentation	8
3.5.1	相机状态向量扩增	8
3.5.2	状态协方差扩增	9
3.6	Measurement Update	9
3.6.1	Measurement Model	9
3.6.2	能观性约束	11
3.6.3	EKF Update	11

1 概述

1.1 MSCKF

MSCKF 全称 Multi-State Constraint Kalman Filter (多状态约束下的 Kalman 滤波器)，是一种基于滤波的 VIO 算法，2007 年由 Mourikis 在 [1] 中首次提出。MSCKF 在 EKF 框架下融合 IMU 和视觉信息，相较于单纯的 VO 算法，MSCKF 能够适应更剧烈的运动、一定时间的纹理缺失等，具有更高的鲁棒性；相较于基于优化的 VIO 算法 (VINS, OKVIS)，MSCKF 精度相当，速度更快，适合在计算资源有限的嵌入式平台运行。在机器人、无人机、AR/VR 领域，MSCKF 都有较为广泛的运用，如 Google Project Tango 就用了 MSCKF 进行位姿估计。

1.2 MSCKF vs EKF-SLAM

在传统的 EKF-SLAM 框架中，特征点的信息会加入到特征向量和协方差矩阵里，这种方法的缺点是特征点的信息会给一个初始深度和初始协方差，如果不正确的话，极易导致后面不收敛，出现 inconsistent 的情况。MSCKF 维护一个 pose 的 FIFO，按照时间顺序排列，可以称为滑动窗口，一个特征点在滑动窗口的几个位姿都被观察到的话，就会在这几个位姿间建立约束，从而进行 KF 的更新。[4]

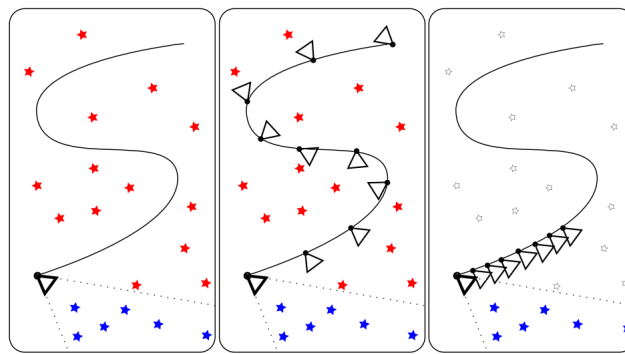
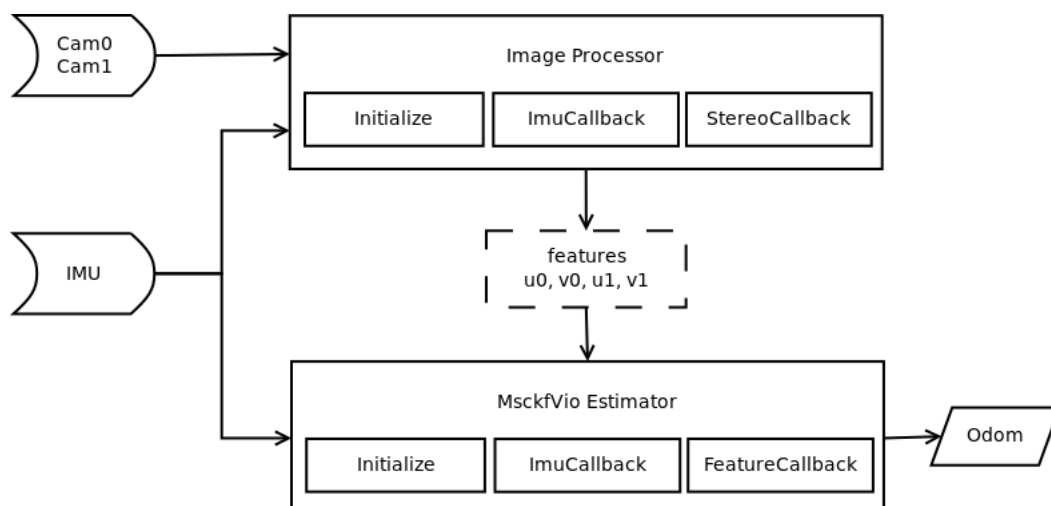


图 1 EKF-SLAM, keyframe-based SLAM, MSCKF

1.3 S-MSCKF

S-MSCKF [2] 是宾大 Vijay Kumar 实验室开源的双目版本 MSCKF 算法。



2 Image Processor

2.1 Initialize

- load parameters
- create FastFeatureDetector

2.2 ImuCallback

第一帧图像后，不断添加 IMU message 到 imu_msg_buffer。

2.3 StereoCallback

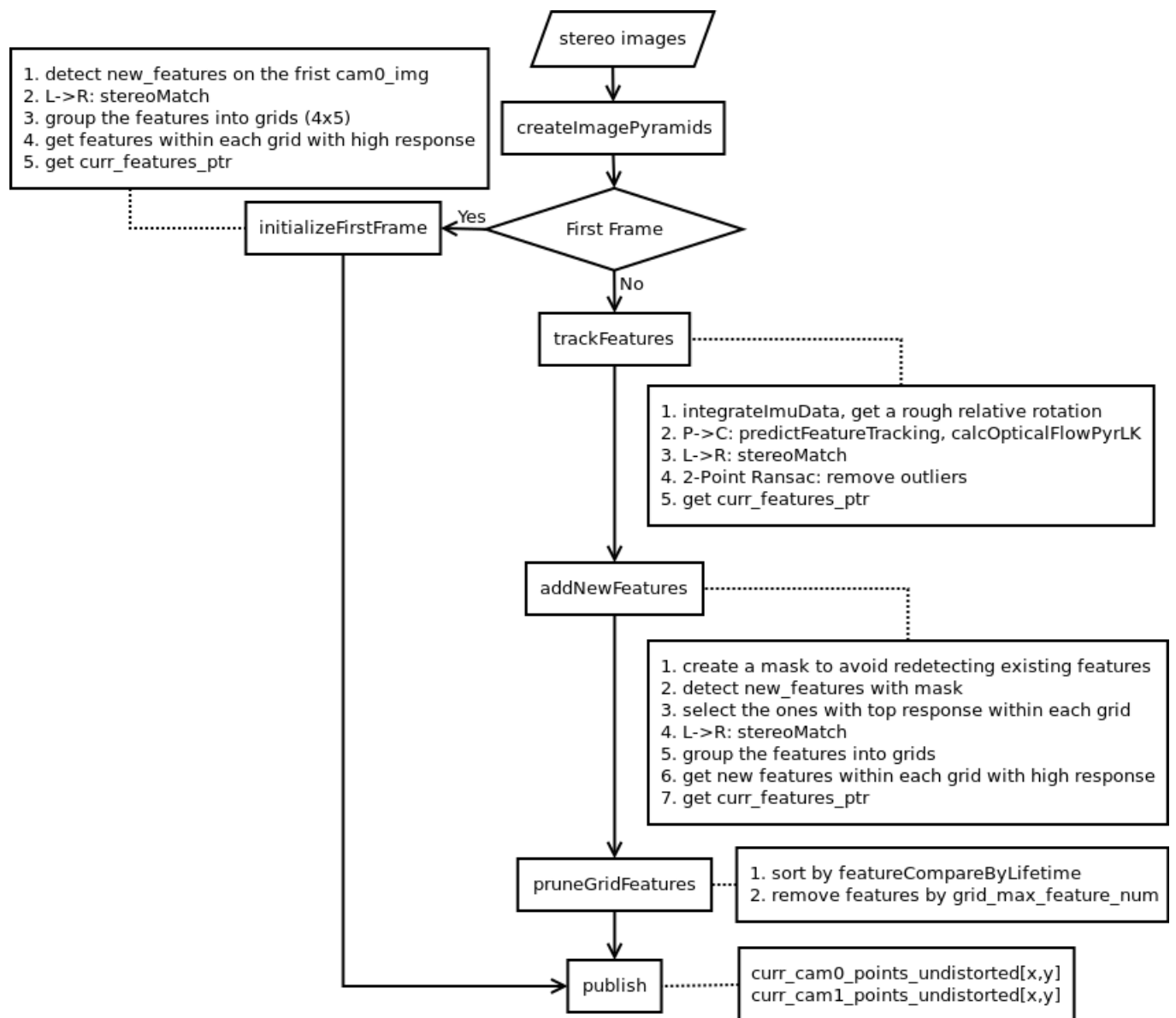


图 2 StereoCallback 流程图

3 MsckfVio Estimator/Filter

3.1 Kalman Filter Overview

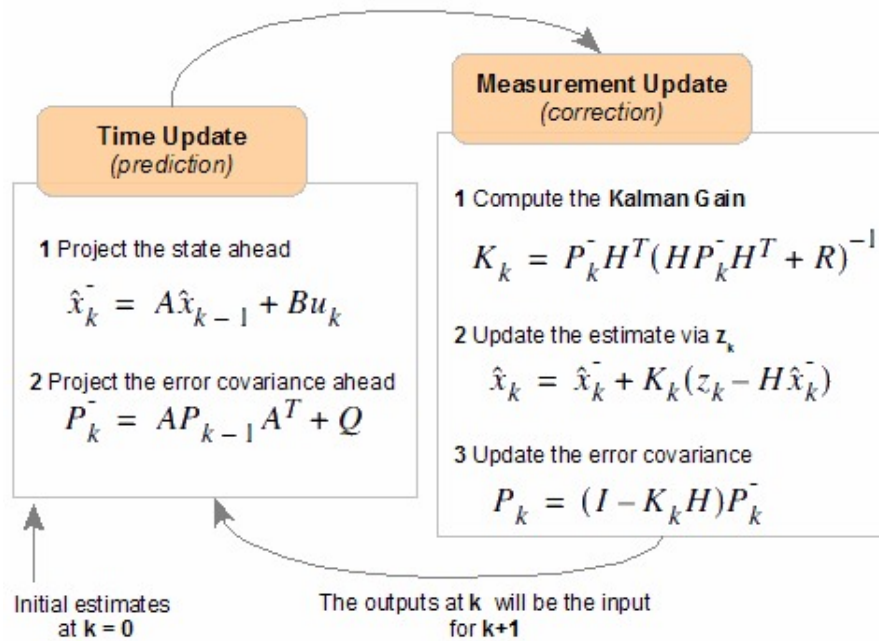


图 3 Kalman Filter 流程图

3.2 代码流程

3.2.1 Initialize

- Load Parameters
- Initialize state server: `state_server.continuous_noise_cov`
- Initialize the chi squared test table with confidence level 0.95: `chi_squared_test_table`

3.2.2 ImuCallback

主要内容为 `initializeGravityAndBias`, 要求前 200 帧 IMU 是静止不动

- 将前 200 帧加速度和角速度求平均
- 平均加速度的模值 g 作为重力加速度: `IMUState::gravity`
- 平均角速度作为陀螺仪的 bias: `state_server.imu_state.gyro_bias`
- 计算重力向量 $(0,0,-g)$ 和平均加速度之间的夹角 (旋转四元数), 标定初始时刻 IMU 系与 world 系之间的夹角: `state_server.imu_state.orientation`

3.2.3 FeatureCallback

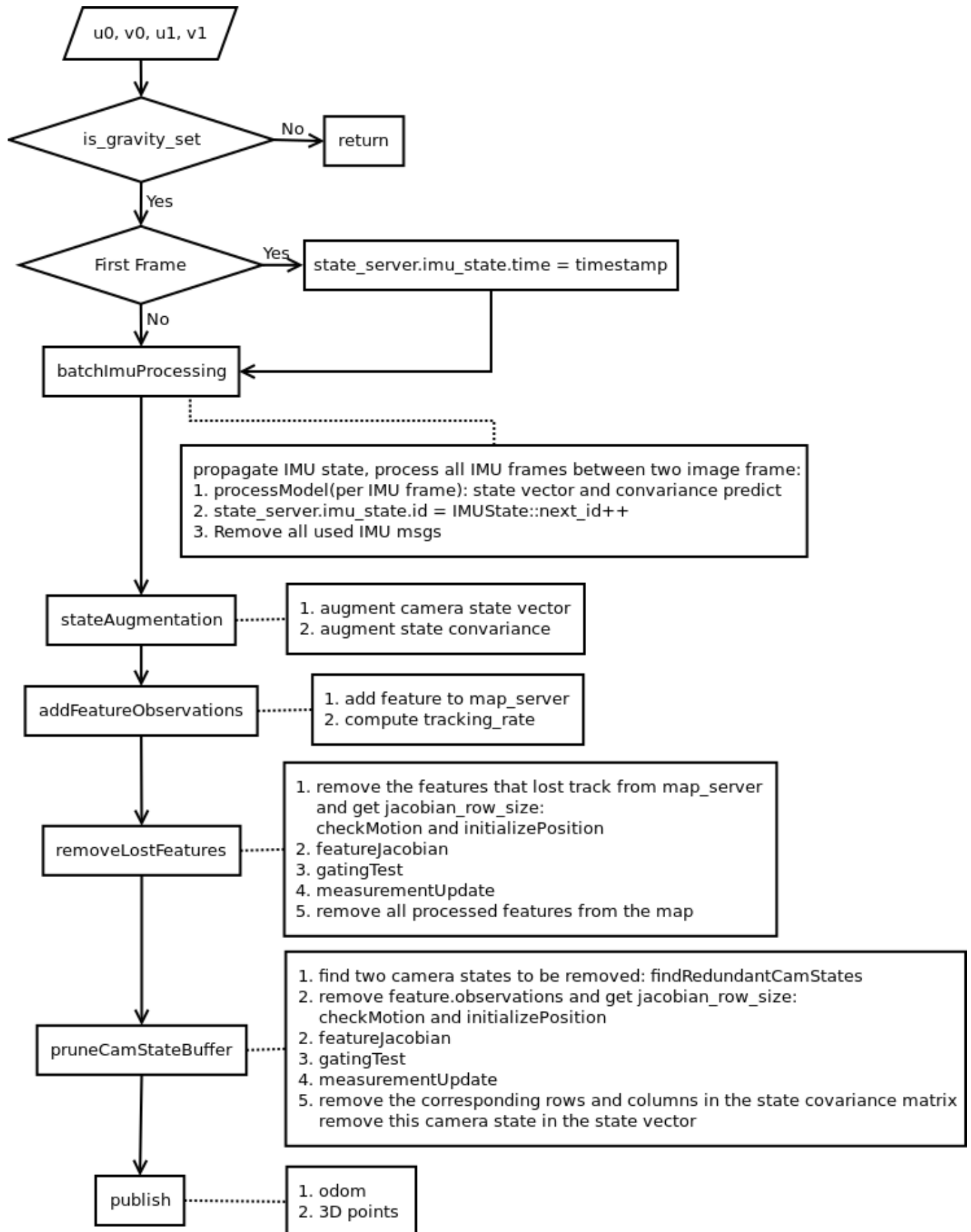


图 4 FeatureCallback 流程图

3.3 EKF 状态向量

IMU 状态向量

$$\mathbf{x}_I = \begin{pmatrix} {}^I_G \mathbf{q}^\top & \mathbf{b}_g^\top & {}^G \mathbf{v}_I^\top & \mathbf{b}_a^\top & {}^G \mathbf{p}_I^\top & {}^I_C \mathbf{q}^\top & {}^I_C \mathbf{p}_C^\top \end{pmatrix}^\top$$

IMU 误差状态向量

$$\tilde{\mathbf{x}}_I = \begin{pmatrix} {}^I_G \tilde{\boldsymbol{\theta}}^\top & \tilde{\mathbf{b}}_g^\top & {}^G \tilde{\mathbf{v}}_I^\top & \tilde{\mathbf{b}}_a^\top & {}^G \tilde{\mathbf{p}}_I^\top & {}^I_C \tilde{\boldsymbol{\theta}}^\top & {}^I_C \tilde{\mathbf{p}}_C^\top \end{pmatrix}^\top \in \mathbb{R}^{21 \times 1}$$

Camera 误差状态向量

$$\tilde{\mathbf{x}}_{C_i} = \begin{pmatrix} {}^{C_i}_G \tilde{\boldsymbol{\theta}}^\top & {}^G \tilde{\mathbf{p}}_{C_i}^\top \end{pmatrix}^\top \in \mathbb{R}^{6 \times 1}$$

系统 (Imu+Camera) 误差状态向量

$$\tilde{\mathbf{x}} = \begin{pmatrix} \tilde{\mathbf{x}}_I^\top & \tilde{\mathbf{x}}_{C_1}^\top & \cdots & \tilde{\mathbf{x}}_{C_N}^\top \end{pmatrix}^\top \in \mathbb{R}^{(21+6N) \times 1}$$

3.4 Propagation/Prediction

3.4.1 IMU 误差状态方程

IMU 运动微分方程

$$\begin{cases} {}^I_G \dot{\mathbf{q}} = \frac{1}{2} \Omega(\hat{\boldsymbol{\omega}}) {}^I_G \hat{\mathbf{q}} \\ \dot{\mathbf{b}}_g = \mathbf{0}_{3 \times 1} \\ {}^G \dot{\mathbf{v}} = C ({}^I_G \hat{\mathbf{q}})^\top \hat{\mathbf{a}} + {}^G \mathbf{g} \\ \dot{\mathbf{b}}_a = \mathbf{0}_{3 \times 1}, \\ {}^G \dot{\mathbf{p}}_I = {}^G \hat{\mathbf{v}} \\ {}^I_C \dot{\mathbf{q}} = \mathbf{0}_{3 \times 1} \\ {}^I_C \dot{\mathbf{p}}_C = \mathbf{0}_{3 \times 1} \end{cases} \quad (1)$$

其中,

$$\hat{\boldsymbol{\omega}} = \boldsymbol{\omega}_m - \hat{\mathbf{b}}_g, \quad \hat{\mathbf{a}} = \mathbf{a}_m - \hat{\mathbf{b}}_a$$

并且

$$\Omega(\hat{\boldsymbol{\omega}}) = \begin{pmatrix} -[\hat{\boldsymbol{\omega}}_\times] & \hat{\boldsymbol{\omega}} \\ -\hat{\boldsymbol{\omega}}^\top & 0 \end{pmatrix}$$

根据式 (1), 得到 IMU 误差状态方程

$$\dot{\tilde{\mathbf{x}}}_I = \mathbf{F} \tilde{\mathbf{x}}_I + \mathbf{G} \mathbf{n}_I \quad (2)$$

其中, \mathbf{F} 和 \mathbf{G} (代码在 `MsckfVio::predictNewState`)

$$\mathbf{F}_{21 \times 21} = \begin{pmatrix} -[\hat{\boldsymbol{\omega}}_{\times}] & -\mathbf{I}_3 & \mathbf{0}_{3 \times 3} & \mathbf{0}_{3 \times 3} & \mathbf{0}_{3 \times 3} & \mathbf{0}_{3 \times 3} & \mathbf{0}_{3 \times 3} \\ \mathbf{0}_{3 \times 3} & \mathbf{0}_{3 \times 3} & \mathbf{0}_{3 \times 3} & \mathbf{0}_{3 \times 3} & \mathbf{0}_{3 \times 3} & \mathbf{0}_{3 \times 3} & \mathbf{0}_{3 \times 3} \\ -C \left(\begin{smallmatrix} I \\ G \end{smallmatrix} \hat{\mathbf{q}} \right)^{\top} [\hat{\mathbf{a}}_{\times}] & \mathbf{0}_{3 \times 3} & \mathbf{0}_{3 \times 3} & -C \left(\begin{smallmatrix} I \\ G \end{smallmatrix} \hat{\mathbf{q}} \right)^{\top} & \mathbf{0}_{3 \times 3} & \mathbf{0}_{3 \times 3} & \mathbf{0}_{3 \times 3} \\ \mathbf{0}_{3 \times 3} & \mathbf{0}_{3 \times 3} & \mathbf{0}_{3 \times 3} & \mathbf{0}_{3 \times 3} & \mathbf{0}_{3 \times 3} & \mathbf{0}_{3 \times 3} & \mathbf{0}_{3 \times 3} \\ \mathbf{0}_{3 \times 3} & \mathbf{0}_{3 \times 3} & \mathbf{I}_3 & \mathbf{0}_{3 \times 3} & \mathbf{0}_{3 \times 3} & \mathbf{0}_{3 \times 3} & \mathbf{0}_{3 \times 3} \\ \mathbf{0}_{3 \times 3} & \mathbf{0}_{3 \times 3} & \mathbf{0}_{3 \times 3} & \mathbf{0}_{3 \times 3} & \mathbf{0}_{3 \times 3} & \mathbf{0}_{3 \times 3} & \mathbf{0}_{3 \times 3} \\ \mathbf{0}_{3 \times 3} & \mathbf{0}_{3 \times 3} & \mathbf{0}_{3 \times 3} & \mathbf{0}_{3 \times 3} & \mathbf{0}_{3 \times 3} & \mathbf{0}_{3 \times 3} & \mathbf{0}_{3 \times 3} \end{pmatrix}$$

$$\mathbf{G}_{21 \times 12} = \begin{pmatrix} -\mathbf{I}_3 & \mathbf{0}_{3 \times 3} & \mathbf{0}_{3 \times 3} & \mathbf{0}_{3 \times 3} \\ \mathbf{0}_{3 \times 3} & \mathbf{I}_3 & \mathbf{0}_{3 \times 3} & \mathbf{0}_{3 \times 3} \\ \mathbf{0}_{3 \times 3} & \mathbf{0}_{3 \times 3} & -C \left(\begin{smallmatrix} I \\ G \end{smallmatrix} \hat{\mathbf{q}} \right)^{\top} & \mathbf{0}_{3 \times 3} \\ \mathbf{0}_{3 \times 3} & \mathbf{0}_{3 \times 3} & \mathbf{0}_{3 \times 3} & \mathbf{0}_{3 \times 3} \\ \mathbf{0}_{3 \times 3} & \mathbf{0}_{3 \times 3} & \mathbf{0}_{3 \times 3} & \mathbf{I}_3 \\ \mathbf{0}_{3 \times 3} & \mathbf{0}_{3 \times 3} & \mathbf{0}_{3 \times 3} & \mathbf{0}_{3 \times 3} \\ \mathbf{0}_{3 \times 3} & \mathbf{0}_{3 \times 3} & \mathbf{0}_{3 \times 3} & \mathbf{0}_{3 \times 3} \end{pmatrix}$$

IMU 噪声向量

$$\mathbf{n}_I^{\top} = (\mathbf{n}_g^{\top} \mathbf{n}_{wg}^{\top} \mathbf{n}_a^{\top} \mathbf{n}_{wa}^{\top})^{\top} \in \mathbb{R}^{12 \times 1}$$

其对应的噪声协方差矩阵

$$\mathbf{Q}_I = \mathbb{E} [\mathbf{n}_I \mathbf{n}_I^{\top}] \in \mathbb{R}^{12 \times 12}$$

3.4.2 IMU 状态向量预测

代码在 `MsckfVio::predictNewState`。

- 姿态预测 (0 阶四元数积分, 根据 [3] 中 122 式)

$$\begin{smallmatrix} I \\ G \end{smallmatrix} \mathbf{q}(t_{k+1}) = \left(\cos \left(\frac{|\boldsymbol{\omega}|}{2} \Delta t \right) \cdot \mathbf{I}_{4 \times 4} + \frac{1}{|\boldsymbol{\omega}|} \sin \left(\frac{|\boldsymbol{\omega}|}{2} \Delta t \right) \cdot (\boldsymbol{\omega}) \right) \begin{smallmatrix} I \\ G \end{smallmatrix} \mathbf{q}(t_k) \quad (3)$$

- 位置和速度预测 (4 阶 Runge-Kutta 积分)

$$y_{n+1} = y_n + \frac{\Delta t}{6} (k_1 + 2k_2 + 2k_3 + k_4) \quad (4)$$

3.4.3 系统状态协方差预测

代码在 `MsckfVio::processModel`。

离散时间状态转移矩阵

$$\begin{aligned} \Phi_k &= \Phi(t_{k+1}, t_k) \\ &= \exp \left(\int_{t_k}^{t_{k+1}} \mathbf{F}(\tau) d\tau \right) \\ &= \exp(\mathbf{F} \Delta t) \\ &\approx \mathbf{I} + \mathbf{F} \Delta t + \frac{1}{2} (\mathbf{F} \Delta t)^2 + \frac{1}{6} (\mathbf{F} \Delta t)^3 \quad (\Delta t \text{ 比较小时}) \end{aligned} \quad (5)$$

离散时间噪声协方差矩阵

$$\begin{aligned} \mathbf{Q}_k &= \int_{t_k}^{t_{k+1}} \Phi(t_{k+1}, \tau) \mathbf{G} \mathbf{Q}_I \mathbf{G}^T \Phi(t_{k+1}, \tau)^T d\tau \\ &\approx \Phi_k \mathbf{G} \mathbf{Q}_I \mathbf{G}^T \Phi_k^T \Delta t \end{aligned} \quad (6)$$

IMU 状态传播协方差矩阵为

$$\mathbf{P}_{II_{k+1}|k} = \Phi_k \mathbf{P}_{II_{k|k}} \Phi_k^T + \mathbf{Q}_k$$

系统状态传播协方差矩阵拆解表示为

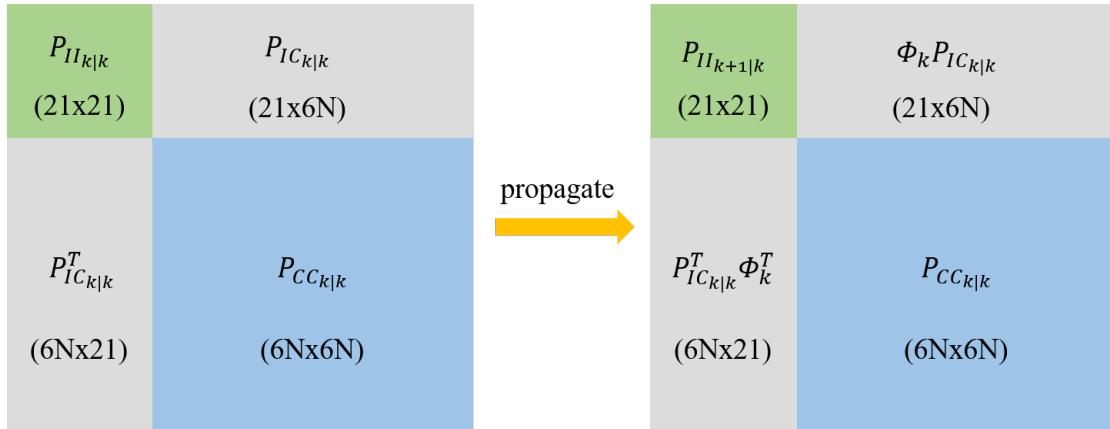
$$\mathbf{P}_{k|k} = \begin{pmatrix} \mathbf{P}_{II_{k|k}} & \mathbf{P}_{IC_{k|k}} \\ \mathbf{P}_{IC_{k|k}}^T & \mathbf{P}_{CC_{k|k}} \end{pmatrix}$$

其传播形式表示为

$$\mathbf{P}_{k+1|k} = \begin{pmatrix} \mathbf{P}_{II_{k+1|k}} & \Phi_k \mathbf{P}_{IC_{k|k}} \\ \mathbf{P}_{IC_{k|k}}^T \Phi_k^T & \mathbf{P}_{CC_{k|k}} \end{pmatrix}$$

其中 Camera 的 covariance 暂时还没有变化是因为这个时间段图像还没有到来, 只有 IMU 的影响, 但是会影响到 IMU 与 Camera 协方差。

整个状态 (IMU+Camera) 的 covariance 传播过程如图所示 [4]:



3.5 State Augmentation

代码在 `MsckfVio::stateAugmentation`。

3.5.1 相机状态向量扩增

根据 IMU 位姿求取 Camera 位姿

$$\begin{aligned} {}^C \hat{\mathbf{q}} &= {}^C \hat{\mathbf{q}} \otimes {}^I \hat{\mathbf{q}} \\ {}^G \hat{\mathbf{p}}_C &= {}^G \hat{\mathbf{p}}_C + C ({}^I \hat{\mathbf{q}})^T {}^I \hat{\mathbf{p}}_C \end{aligned} \quad (7)$$

3.5.2 状态协方差扩增

增广的状态协方差矩阵为

$$\begin{aligned}\mathbf{P}'_{k|k} &= \begin{pmatrix} \mathbf{I}_{21+6N} \\ \mathbf{J} \end{pmatrix} \mathbf{P}_{k|k} \begin{pmatrix} \mathbf{I}_{21+6N} \\ \mathbf{J} \end{pmatrix}^T \\ &= \begin{bmatrix} \mathbf{P}_{k|k} & (\mathbf{J}\mathbf{P}_{k|k})^T \\ \mathbf{J}\mathbf{P}_{k|k} & \mathbf{J}\mathbf{P}_{k|k}\mathbf{J}^T \end{bmatrix}\end{aligned}\quad (8)$$

其中,

$$\mathbf{J} = (\mathbf{J}_I \quad \mathbf{0}_{6 \times 6N})$$

$$\mathbf{J}_I = \begin{pmatrix} C \begin{pmatrix} I_G \hat{\mathbf{q}} \\ -C \begin{pmatrix} I_G \hat{\mathbf{q}} \end{pmatrix}^T [I \hat{\mathbf{p}}_{C \times}] \end{pmatrix} & \mathbf{0}_{3 \times 9} & \mathbf{0}_{3 \times 3} & \mathbf{I}_3 & \mathbf{0}_{3 \times 3} \\ \mathbf{0}_{3 \times 9} & \mathbf{I}_3 & \mathbf{0}_{3 \times 3} & \mathbf{0}_{3 \times 3} & \mathbf{I}_3 \end{pmatrix}$$

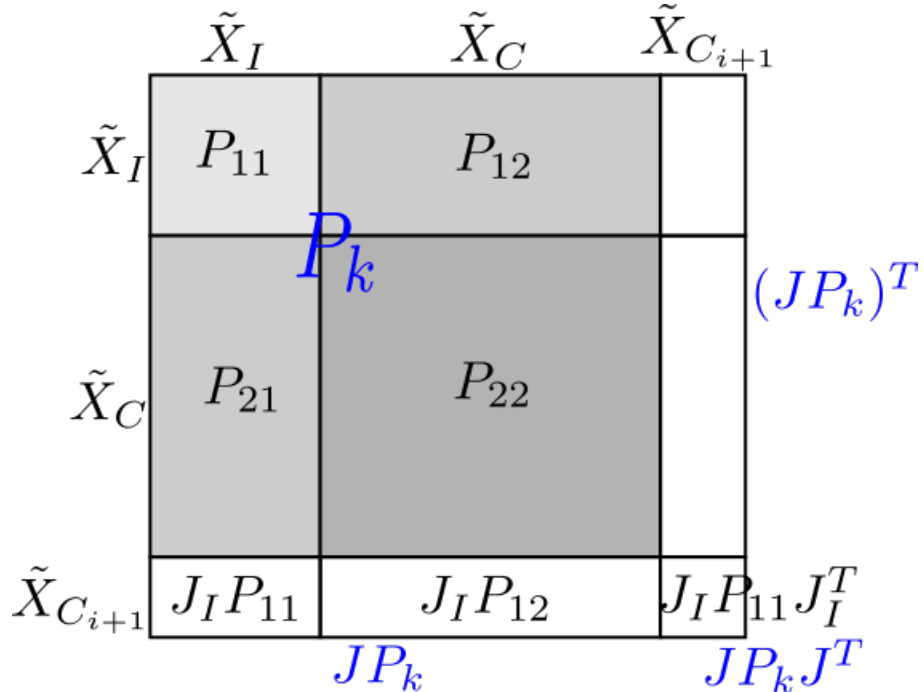
为表示方便, 拆解 $\mathbf{P}_{k|k}$ 为

$$\mathbf{P}_{k|k} = \begin{bmatrix} \mathbf{P}_{11} & \mathbf{P}_{12} \\ \mathbf{P}_{21} & \mathbf{P}_{22} \end{bmatrix}\quad (9)$$

则

$$\mathbf{P}'_{k|k} = \begin{bmatrix} \mathbf{P}_{k|k} & \mathbf{J}_P^T \\ \mathbf{J}_P & \mathbf{J}_I \mathbf{P}_{11} \mathbf{J}_I^T \end{bmatrix} \quad \text{where} \quad \mathbf{J}_P = (\mathbf{J}_I \mathbf{P}_{11} \quad \mathbf{J}_I \mathbf{P}_{12}) \quad (10)$$

图形化表示如下



3.6 Measurement Update

3.6.1 Measurement Model

1. 计算获取世界坐标系下的 3D 特征点, 代码在 `Feature::generateInitialGuess`

- 根据对极几何原理，三角化计算初始深度，得到初始三维点坐标
- 通过 L-M 算法迭代优化得到更加精确的世界系三维点

2. 投影世界系三维点到相机系

$$\begin{aligned} {}^{C_{i,1}}\mathbf{p}_j &= \begin{pmatrix} {}^{C_{i,1}}X_j \\ {}^{C_{i,1}}Y_j \\ {}^{C_{i,1}}Z_j \end{pmatrix} = C \begin{pmatrix} {}^{C_{i,1}}\mathbf{q} \\ G \end{pmatrix} ({}^G\mathbf{p}_j - {}^G\mathbf{p}_{C_{i,1}}) \\ {}^{C_{i,2}}\mathbf{p}_j &= \begin{pmatrix} {}^{C_{i,2}}X_j \\ {}^{C_{i,2}}Y_j \\ {}^{C_{i,2}}Z_j \end{pmatrix} = C \begin{pmatrix} {}^{C_{i,2}}\mathbf{q} \\ G \end{pmatrix} ({}^G\mathbf{p}_j - {}^G\mathbf{p}_{C_{i,2}}) \\ &= C \begin{pmatrix} {}^{C_{i,2}}\mathbf{q} \\ {}^{C_{i,1}}\mathbf{q} \end{pmatrix} ({}^{C_{i,1}}\mathbf{p}_j - {}^{C_{i,1}}\mathbf{p}_{C_{i,2}}) \end{aligned}$$

3. 线性化测量模型，视觉测量残差可近似表示为

$$\mathbf{r}_i^j = \mathbf{z}_i^j - \hat{\mathbf{z}}_i^j = \mathbf{H}_{C_i}^j \tilde{\mathbf{x}}_{C_i} + \mathbf{H}_{f_i}^j G \tilde{\mathbf{p}}_j + \mathbf{n}_i^j \quad (11)$$

其中，测量雅克比矩阵（代码在 `MsckfVio::measurementJacobian`）

$$\begin{aligned} \mathbf{H}_{C_i}^j &= \frac{\partial \mathbf{z}_i^j}{\partial {}^{C_{i,1}}\mathbf{p}_j} \cdot \frac{\partial {}^{C_{i,1}}\mathbf{p}_j}{\partial \mathbf{x}_{C_{i,1}}} + \frac{\partial \mathbf{z}_i^j}{\partial {}^{C_{i,2}}\mathbf{p}_j} \cdot \frac{\partial {}^{C_{i,2}}\mathbf{p}_j}{\partial \mathbf{x}_{C_{i,1}}} \\ \mathbf{H}_{f_i}^j &= \frac{\partial \mathbf{z}_i^j}{\partial {}^{C_{i,1}}\mathbf{p}_j} \cdot \frac{\partial {}^{C_{i,1}}\mathbf{p}_j}{\partial {}^G\mathbf{p}_j} + \frac{\partial \mathbf{z}_i^j}{\partial {}^{C_{i,2}}\mathbf{p}_j} \cdot \frac{\partial {}^{C_{i,2}}\mathbf{p}_j}{\partial {}^G\mathbf{p}_j} \end{aligned} \quad (12)$$

问题：Modify the measurement Jacobian to ensure observability constrain

4. 叠加对同一特征点的多个观测（代码在 `MsckfVio::featureJacobian`）

$$\mathbf{r}^j = \mathbf{H}_x^j \tilde{\mathbf{x}} + \mathbf{H}_f^j G \tilde{\mathbf{p}}_j + \mathbf{n}^j$$

5. 为避免 ${}^G\mathbf{p}_j$ 的不确定性对测量残差的影响，将残差投影到 $\mathbf{H}_{f_i}^j$ 的左零空间

$$\mathbf{r}_o^j = \mathbf{V}^\top \mathbf{r}^j = \mathbf{V}^\top \mathbf{H}_x^j \tilde{\mathbf{x}} + \mathbf{V}^\top \mathbf{n}^j = \mathbf{H}_{x,o}^j \tilde{\mathbf{x}} + \mathbf{n}_o^j \quad (13)$$

零空间 \mathbf{V} 通过 SVD 分解得到（代码在 `MsckfVio::featureJacobian`）

```
// Project the residual and Jacobians onto the nullspace of H_fj.
JacobiSVD<MatrixXd> svd_helper(H_fj, ComputeFullU | ComputeThinV);
MatrixXd A = svd_helper.matrixU().rightCols(jacobian_row_size - 3);
H_x = A.transpose() * H_xj;
r_o = A.transpose() * r_j;
```

6. 叠加所有特征点的多个观测，得到

$$\mathbf{r}_o = \mathbf{H}_x \tilde{\mathbf{X}} + \mathbf{n}_o \quad (14)$$

```
if (gatingTest(H_xj, r_j, cam_state_ids.size()-1)) {
    H_x.block(stack_cntr, 0, H_xj.rows(), H_xj.cols()) = H_xj;
    r.segment(stack_cntr, r_j.rows()) = r_j;
    stack_cntr += H_xj.rows();
}
```

3.6.2 能观性约束

OC-EKF

3.6.3 EKF Update

代码在 `MsckfVio::measurementUpdate`。

根据 [1], 为降低 EKF 更新的计算复杂度, 对 \mathbf{H}_X 进行 QR 分解

$$\mathbf{H}_X = [\mathbf{Q}_1 \quad \mathbf{Q}_2] \begin{bmatrix} \mathbf{T}_H \\ \mathbf{0} \end{bmatrix} \quad (15)$$

带入式 (14), 得

$$\mathbf{r}_o = [\mathbf{Q}_1 \quad \mathbf{Q}_2] \begin{bmatrix} \mathbf{T}_H \\ \mathbf{0} \end{bmatrix} \tilde{\mathbf{X}} + \mathbf{n}_o \quad (16)$$

$$\begin{bmatrix} \mathbf{Q}_1^T \mathbf{r}_o \\ \mathbf{Q}_2^T \mathbf{r}_o \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} \mathbf{T}_H \\ \mathbf{0} \end{bmatrix} \tilde{\mathbf{X}} + \begin{bmatrix} \mathbf{Q}_1^T \mathbf{n}_o \\ \mathbf{Q}_2^T \mathbf{n}_o \end{bmatrix} \quad (17)$$

上式 $\mathbf{Q}_2^T \mathbf{r}_o$ 仅含有噪声, 对其忽略, 取 $\mathbf{Q}_1^T \mathbf{r}_o$ 用于 EKF 更新

$$\mathbf{r}_n = \mathbf{Q}_1^T \mathbf{r}_o = \mathbf{T}_H \tilde{\mathbf{X}} + \mathbf{n}_n \quad (18)$$

噪声向量 \mathbf{n}_n 的协方差矩阵为

$$\mathbf{R}_n = \mathbf{Q}_1^T \mathbf{R}_o \mathbf{Q}_1 = \sigma_{\text{im}}^2 \mathbf{I}_r \quad (19)$$

计算 Kalman 增益

$$\mathbf{K} = \mathbf{P} \mathbf{T}_H^T (\mathbf{T}_H \mathbf{P} \mathbf{T}_H^T + \mathbf{R}_n)^{-1} \quad (20)$$

更新系统误差状态

$$\Delta \mathbf{X} = \mathbf{K} \mathbf{r}_n \quad (21)$$

更新系统状态

$$\mathbf{X}_{k+1} = \mathbf{X}_k \oplus \Delta \mathbf{X} \quad (22)$$

更新系统状态协方差矩阵

$$\mathbf{P}_{k+1|k+1} = (\mathbf{I}_\xi - \mathbf{K} \mathbf{T}_H) \mathbf{P}_{k+1|k} (\mathbf{I}_\xi - \mathbf{K} \mathbf{T}_H)^T + \mathbf{K} \mathbf{R}_n \mathbf{K}^T \quad (23)$$

参考文献

- [1] Anastasios I Mourikis and Stergios I Roumeliotis. A multi-state constraint kalman filter for vision-aided inertial navigation. In *Proceedings 2007 IEEE International Conference on Robotics and Automation*, pages 3565–3572. IEEE, 2007.
- [2] Ke Sun, Kartik Mohta, Bernd Pfrommer, Michael Watterson, Sikang Liu, Yash Mulgaonkar, Camillo J Taylor, and Vijay Kumar. Robust stereo visual inertial odometry for fast autonomous flight. *IEEE Robotics and Automation Letters*, 3(2):965–972, 2018.
- [3] Nikolas Trawny and Stergios I Roumeliotis. Indirect kalman filter for 3d attitude estimation. *University of Minnesota, Dept. of Comp. Sci. & Eng., Tech. Rep*, 2:2005, 2005.
- [4] 钟心亮. 一步步深入了解 s-msckf. http://www.xinliang-zhong.vip/msckf_notes/, 2019.