**一、原理简介**

卡尔曼滤波（Kalman filtering）是一种利用线性系统状态方程，通过系统输入输出观测数据，对系统状态进行最优估计的算法。由于观测数据中包括系统中的噪声和干扰的影响，所以最优估计也可看作是滤波过程。Kalman滤波在测量方差已知的情况下能够从一系列存在测量噪声的数据中，估计动态系统的状态。特点是在线性状态空间表示的基础上对有噪声的输入和观测信号进行处理，求取系统状态或真实信号。

**二、名词解释**

平稳随机过程：信号的全部统计特性不随时间的变化而变化。

维纳滤波需要保证信号和噪声都是平稳随机过程，卡尔曼滤波不要求信号和噪声都是平稳过程的假设条件。

**三、性质**

①卡尔曼滤波是一个算法，它适用于线性、离散和有限维系统。每一个有外部变量的自回归移动平均系统(ARMAX)或可用有理传递函数表示的系统都可以转换成用状态空间表示的系统，从而能用卡尔曼滤波进行计算。

②任何一组观测数据都无助于消除x(t)的确定性。增益K(t)也同样地与观测数据无关。

③当观测数据和状态联合服从高斯分布时用卡尔曼递归公式计算得到的是高斯随机变量的条件均值和条件方差，从而卡尔曼滤波公式给出了计算状态的条件概率密度的更新过程线性最小方差估计，也就是最小方差估计。

**四、解释**

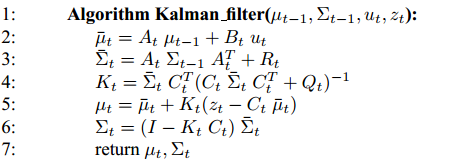
1卡尔曼滤波器是一个“optimal recursive data processing algorithm（最优化自回归数据处理算法），卡尔曼滤波器不断的把协方差(covariance)递归，从而估算出最优的值。他运行的很快，而且它只保留了上一时刻的协方差(covariance)。上面的Kg，就是卡尔曼增益（Kalman Gain）。他可以随不同的时刻而改变他自己的值。

2.通俗解释：我们有两个可以得到结果的东西，一个是离散递推模型，另一个是传感器的实际观测值，两个东西都是存在误差的，所以都可以看成是一个正态分布，对于这两个正态分布取加权平均就可以得到一个较为准确的系统状态变量，这里的权重就是卡尔曼增益。

Kalman滤波算法的本质就是利用两个正态分布的融合仍是正态分布这一特性进行迭代。

3. 假如我们要估计一架飞行器的姿态，可以通过IMU来实时测量，但是测量值有一定的风险是不准确的，所以并不能完全依赖传感器。任何一个满足物理规律的系统应当是连续的，所以我们还可以通过上一状态来预测当前状态。Kalman Filter正是结合这两条进行状态估计，到底是相信哪一个多一点，还要根据Kt来决定，我们定义Kt为卡尔曼增益，它是根据 测量和预测的协方差来计算的。

4.五条重要的公式



（2）高斯噪声均值为0，所以可省去最后一项。

（3）除了预测均值之外，我们还需要预测值的协方差来计算Kalman增益。

（4）准备工作完成之后，需要根据预测值的协方差这里写图片描述，测量值和状态的比例系数，测量值的协方差来计算Kalman增益。增益越大，表明我们越相信测量值。

（5）现在我们有了对状态的预测值和协方差，同时也收集到了对状态的测量值。这时就可以通过kalman增益来计算状态估计值了。

（6）预测当前状态需要用到上一状态的协方差，所以我们还需要计算当前状态的协方差用于下一次迭代。它同样要根据Kalman增益来计算。

算法中，从初始状态开始，不断计算当前状态的均值和方差来迭代，直至系统结束。输入的参数是上一次的状态矢量、上一次的协方差矩阵、将要执行的控制量（这个控制量一般为0）、当前的测量值。

Rt是方差。

5.后续

经典的卡尔曼滤波只适用于线性且满足高斯分布的系统，但实际工程中并不是这么简单，比如飞行器在水平运动时有可能伴随着自身的自旋，这时就需要应用扩展卡尔曼滤波（EKF）来解决这种情况。

6.说明

经典滤波器是建立在信号和噪声频率分离的基础上,通过将噪声所在频率区域幅值衰减来达到提高信噪比,于是针对不同的频率段就产生了低通,高通,带通等滤波器之分。而现代滤波器,则不是建立在频率领域,而是通过随机过程的数学手段,通过对噪声和信号的统计特性做一定的假定,然后通过合适的数学方式,来提供信噪比.

**五、参考资料**

1. <http://blog.csdn.net/lizilpl/article/details/45268471> --- 关于卡尔曼滤波的详细解释

2. 滤波是一个理性智能体为了把握当前状态以便进行理性决策所采取的行动

3. <http://blog.csdn.net/baimafujinji/article/details/50646814> --- 关于卡尔曼滤波的详细解释

**六、参考程序**

