

Kalmanfilter はガウス分布と線形性が成り立つと仮定されている
またモデルについて

$$X_t = K_x X_{t-1} \quad (1)$$

ベイズ則は, 次の式で表される.

$$P(B|A) = \frac{P(A|B)P(B)}{P(A)} \quad (2)$$

$$P(z_{i,t})t_i \quad (3)$$

また確率の基本法則として
加法定理

$$P(X) = \sigma 1 p(X, Y) \quad (4)$$

乗法定理

$$P(X, Y) = p(Y|X)p(X) \quad (5)$$

参考文献

- [1] Sebastian Thrun, Wolfram Burgard, Dieter Fox, ”確率ロボティクス”, 2015, マイナビ出版
- [2] , 萩原 淳一郎, 瓜生 真也, 牧山 幸史, 石田 基広 , ”基礎からわかる時系列分析”, 2018, Data Science Library