

Kalmanfilter はガウス分布と線形性が成り立つと仮定されている
ベイズ則は, 次の式で表される.

$$P(B|A) = \frac{P(A|B)P(B)}{P(A)} \quad (1)$$

$$P(z_{i,t})t_i \quad (2)$$

また確率の基本法則として
加法定理

$$P(X) = \sigma 1 p(X, Y) \quad (3)$$

乗法定理

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

@bookfoo, author="Donald E. Knuth", title="Searching and Sorting",
publisher="Addison-Wesley", year="1972"