Ein (Kalman-)Filter löst das Filterproblem (bzw das **inverse Problem der Beobachtungsgleichung**?)

* Messung mit Beobachtungsmatrix und Messrauschen
* Gesucht

Ein Zustand besteht aus Erwartungswerten und der Kovarianzmatrix

Normalerweise würde der Rechenaufwand mit jedem neuen Sample wachsen. Beim rekursiven Kalman Filter aber beinhaltet ein Zustand Informationen aus allen vorherigen (Messungen).