

Kalman Filter

Grundlagen

P.Schön, C.Thein

May 20, 2024

Einleitung

Vereinfachte Erklärung

EXAMPLES

Zusammenfassung

Was ist das Kalman Filter?

Das Kalman Filter ist ein mathematisches Verfahren zur iterativen Schätzung von Parametern zur Beschreibung von Systemzuständen.

Dabei wird wiederholt eine Vorhersage über einen Parameterwert abgegeben, mit dem fehleranfälligen Messwert kombiniert, und erneut genutzt um daraus eine Vorhersage zu treffen.

Vorhersage

1. Den nächsten Zustand darstellen: $\hat{x}_k = A\hat{x}_{k-1} + Bu_{k-1}$
2. Die Fehlerkovarianz vorausberechnen: $P_k = AP_{k-1}A^T + Q$

Korrektur

3. Den Kalman Gain berechnen: $K_k = P_k H^T (HP_k H^T + R)^{-1}$
4. Die Schätzung mit z_k aktualisieren: $\hat{x}_k = \hat{x}_k + K_k(z_k - H\hat{x}_k)$
5. Die Fehlerkovarianz aktualisieren: $P_k = (I - K_k H)P_k$

Ablauf des Kalman Filters

- **Fettgedruckt**
- *Kursiv*
- Unterstrichen
- Monospaced

- Erster Punkt
- Zweiter Punkt
- Dritter Punkt

- Inline: $E = mc^2$
- Displayed:

$$\int_0^{\infty} e^{-x^2} dx = \frac{\sqrt{\pi}}{2}$$

Bilder einfügen



Fig.: Ein Beispielbild

In dieser Präsentation haben wir die grundlegenden Elemente von LaTeX vorgestellt, darunter:

- Textformatierung
- Aufzählungen und Listen
- Mathematische Ausdrücke
- Bilder einfügen