

Filtrelemek

Filtreler dis dunyadaki bir aksiyon hakkında elde edilen gurultulu sinyalleri, tersine cevirecek arka plandaki aksiyon hakkında hesaplama yapabilmemizi saglar. Mesela Kalman Filtreleri (KF) icin gizlenmis konum bir robotun nerede oldugu, bir senetin fiyati gibi bir sey olabilir, gizli konum bilgisi x_t degiskeninde o konum hakkındaki gurultulu olcum y_t icindedir. Hem gizli konumlar arasindaki gecis, hem de olcumun gurultusu lineer bir fonksiyon uzerindendir.

$$x_{t+1} = Ax_t + v$$

$$y_t = Hx_t + w$$

v ve w 'in dagilimi Gaussian'dir ve kovaryans sirasiyla Q ve R icindedir.

Zaman faktorunu de dahil etmek gerekirse;

$$\hat{x}_t^t = E[x_t|y_0, \dots, y_t]$$

$$P_t^t = E[(x_t - \hat{x}_{t|t})(x_t - \hat{x}_{t|t})'|y_0, \dots, y_t]$$

Filtremenin amaci x_{t+1} ve P_{t+1} hesabini yeni bir olcum y_{t+1} uzerinden yapmak olacak. “Gizli” x_t derken bunu kastediyorduk, bu deger bize verilmiyor, sadece x_t ve x_{t+1} arasindaki gecisin nasil oldugunu biliyoruz, gurultunun nasil eklendigini biliyoruz, ama bunlari bilsek bile elde bir suru bilinmeyen var. Filtremenin matematiksel numaralari sayesinde bunu hesaplayabiliyor olacagiz. Yani yapmamiz gereken “oku tersine cevirmek”, yani x_t 'nin y_t uzerindeki sartasal baglilikini (conditional dependence) ortaya cikartmak, bunu y_t 'nin x_t 'ye olan sartasal bagimlilikini tersine cevirecek yapmak. Ana denklemin iki tarafinin da beklentisini (expectation) alalim:

$$E x_{t+1} = \hat{x}_{t+1} = A\mu_t = A\hat{x}_t$$

Simdi iki tarafin kovaryansini alalim ve P_t 'yi $cov x(t)$ olarak belirtelim: