



→ Les matrices A, B, C et H ne sont que des matrices de formatage pour que les résultats soient cohérents et aux bonnes dimensions pour les opérations matricielles. Elles permettent aussi de modéliser le fonctionnement du modèle étudié.

→ Les matrices W, Q et Z sont des matrices permettant d'ajouter de l'incertitude dans des systèmes complexes où beaucoup de paramètres sont capables d'être influencés par des événements extérieurs (ex : gravité, vent, pente, ...) ou par des erreurs de mesures (ex : temps de traitement de la donnée) .

- Mise à Jour du gain de Kalman
- Calcul de l'état réel du système