Zeit-Innovationsschritt

Zeit-Innovationsschritten
$$\hat{x}_{t/t-1} = \Phi \cdot \hat{x}_{t-1/t-1}$$

 $P_{t/t-1} = \Phi \cdot P_{t-1/t-1} \cdot \Phi^T + Q$

Mess-Innovationsschritt
$$K_t = P_{t|t-1} \cdot H^T (H \cdot P_{t|t-1} \cdot H^T + R)^{-1}$$

$$K_{t} = P_{t|t-1} \cdot H^{T} (H \cdot P_{t|t-1} \cdot H^{T} + R)^{-1}$$

$$K_{t} = P_{t|t-1} \cdot H^{T} (H \cdot P_{t|t-1} \cdot H^{T} + R)^{-1}$$

$$\hat{x}_{t|t} = \hat{x}_{t|t-1} + K_{t}(z_{t} - H \cdot \hat{x}_{t|t-1})$$

 $P_{t/t} = P_{t/t-1} - K_t \cdot H P_{t/t-1}$