

Kalman Filter

Felipe Marques

Sumário

1. Introdução
2. *State Space Representation*
3. *Kalman Recursion*
 1. *Kalman Filter*
 2. *Kalman Prediction*
 3. *Kalman Smoothing*
4. Estimação dos parâmetros
5. Inferência com *Kalman Filter*

State Space Representation

Introdução

A representação em estado de espaço é uma forma conveniente de representar as dinâmicas de uma variável através de duas equações que a descreve. (melhorar essa parte)

Essa representação será útil quando tratarmos dos algoritmos de Kalman.
