<http://www.riskofficer.ru/showthread.php?21072-%D4%E8%EB%FC%F2%F0-%CA%E0%EB%EC%E0%ED%E0-%E2-Matlab-e>

**Фильтр Калмана в Matlab'e**

Привет,  
кто знает как в Matlab'е спроектировать фильтр Калмана и создать переменную state-space для системы из 5 уравнений и поставить ограничения, например: a11=const, a12=a13=a14, a22=a23=a24 и т.д.  
  
Вот пример одного из уравнений: r\_mmvb = a11 + a11\*eps1 + a11\*eps2 + a11\*eps3 + v1, где v - Белый Шум  
  
В общем нужно рассчитать фильтр Калмана с ограничениями. Кто знает как?  
  
ss, idss, kalman, kalmz.