

Kalman 滤波练习题

编程实现本章电子讲义中Example4.2, 分别绘制 $\hat{x}_i(k|k) \sim k (i = 1, 2)$ 曲线, 同图绘制 $x_i(k) \sim k$ 曲线 (真值) 以及 $\pm 3\sqrt{P_{ii}(k|k)} \sim k$ 曲线。