

论文与报告

稳态Kalman滤波器增益新算法

邓自立, 李建国

黑龙江大学应用数学研究所, 哈尔滨

收稿日期 1995-3-1 修回日期 网络版发布日期 接受日期

摘要

应用现代时间序列分析方法, 基于ARMA新息模型, 提出了稳态Kalman滤波器增益的两种简单的新算法, 并证明了它们的等价性. 应用ARMA新息模型参数的递推辨识器伴随新算法, 可实现自校正Kalman滤波器. 仿真例子说明了其有效性.

关键词 [稳态Kalman滤波器增益](#) [自校正Kalman滤波器](#) [现代时间序列分析方法](#)

分类号

New Algorithms of Stead-State Kalman Filter Gain

Deng Zili, Li Jianguo

Institute of Applied Mathematics, Heilongjiang University, Harbin

Abstract

By using the modern time series analysis method and based on the ARMA innovation model, two new algorithms of steady-state Kalman filter gain are presented, and their equivalence is proved. The self-tuning Kalman filters can be implemented by using a recursive identifier of parameters for the ARMA innovation model, in conjunction with the new algorithms. A simulation example shows usefulness of the proposed algorithms.

Key words [Steady-state Kalman filter gain](#) [self-tuning Kalman filter](#) [modern time series analysis method](#)

DOI:

通讯作者

作者个人主页 [邓自立; 李建国](#)

扩展功能

本文信息

▶ [Supporting info](#)

▶ [PDF \(529KB\)](#)

▶ [\[HTML全文\]\(OKB\)](#)

▶ [参考文献\[PDF\]](#)

▶ [参考文献](#)

服务与反馈

▶ [把本文推荐给朋友](#)

▶ [加入我的书架](#)

▶ [加入引用管理器](#)

▶ [复制索引](#)

▶ [Email Alert](#)

▶ [文章反馈](#)

▶ [浏览反馈信息](#)

相关信息

▶ [本刊中 包含“稳态Kalman滤波器增益”的 相关文章](#)

▶ 本文作者相关文章

· [邓自立](#)

· [李建国](#)