

### **Rachev, Mittnik et al. (2007)**

- Str. 398-404 – vysvětlení všech pojmů a náznaky odvození spojené s Kalmanovým filtrem

### **Kalman filter.pdf**

<https://web.mit.edu/kirtley/kirtley/binlustuff/literature/control/Kalman%20filter.pdf>

- Pěkné a polopatické odvození Kalmanova filtru, kde se dají pochopit všechny využívané výrazy

### **Clark (1987)**

- jednoduchý dynamický model pro odhad mezery výstupu (procvičení zápisu převodu do stavového tvaru a možná identifikace modelu na datech)

### **Harvei, Proietti (2005)**

- Obecně tato kniha představuje detailní představení celé řady možností a problémů spojených s modely ve stavovém tvaru a filtrací
- Kapitola 1 – obecná stavová reprezentace a princip Kalmanova filtru (velmi přehledně zpracováno)
- Kapitola 3 – techničtější úvod do Kalmanova filtru pro staové modely s difuzními počátečními podmínkami (difuzní Kalmanův filtr)

### **Commandeur, Koopman (2007)**

- Kapitola 8 – nejjednodušší jednorozměrná stavová reprezentace v tzv. local-level modelu a jemné naznačení principů Kalmanova filtru
- Kapitola 9 – vícerozměrné zobecnění stavového zápisu (jedna z variant, ne zcela obecná)

### **Harvey (1989)**

- Kapitola 3 - další zápis a souvislosti spojené s Kalmanovým filtrem a jeho vlastnotmi

### **Hamilton (1994)**

- Kapitola 13 – podrobné odvození Kalmanova filtru v kontextu daného zápisu stavového modelu