

$$\begin{bmatrix} \mathbf{z}_{k+1} \\ \mathbf{s}_{k+1} \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} \mathbf{E} & 0 \\ \mathbf{IG} & \mathbf{H} \end{bmatrix} \begin{bmatrix} \mathbf{z}_k \\ \mathbf{s}_k \end{bmatrix} + \begin{bmatrix} \mathbf{F} \\ 0 \end{bmatrix} \mathbf{y}_k$$

$$\mathbf{w}_k = \begin{bmatrix} 0 & \mathbf{J} \end{bmatrix} \begin{bmatrix} \mathbf{z}_k \\ \mathbf{s}_k \end{bmatrix}$$