

$k-1$ k $\theta_{k-1}^- \mid \theta_{k-1}^+$ $P_{k-1}^- \mid P_{k-1}^+$ \mathbf{y}_{k-1} $\theta_k^- \mid \theta_k^+$ $P_k^- \mid P_k^+$ \mathbf{y}_k