



Vstup do nultej iterácie

Počiatocné hodnoty:

ρ

δ

σ^2

Vstup dáta:

x, y

Vstup do n-tej iterácie

$\mu_0^{(n)} = \mu_0^{(n-1)} + \hat{\mu}_{\Delta}^{(n-1)}$

$\rho_0^{(n)} = (\rho - \rho_0^{(n-1)}) + \rho_0^{(n-1)}$

$\nu_0^{(n)} = \nu_0^{(n-1)} + \hat{\nu}_{\Delta}^{(n-1)}$

$(\delta)_0^{(n)} = \hat{\delta}$

$\theta_0^{(n)} = \theta_0^{(n-1)} + \hat{\theta}_{\Delta}^{(n-1)}$

$(\sigma^2)_0^{(n)} = \hat{\sigma}^2$