* 均值和协方差矩阵估计量的迭代运算形式

假设已经计算了N个样本的均值估计量，若再加上一个样本，其新的估计量为：

其中为从N个样本计算得到的估计量。迭代的第一步应取。

协方差矩阵估计量的迭代运算与上述相似。取表示N个样本时的估计量为：



加入一个样本，则：



其中，且，因此为零矩阵。