

Algoritmo de suavizamiento punto fijo

$$\hat{x}(k/j) = \hat{x}(k/j - 1) + K(k, j)[z(j) - p(j)H(j)\hat{x}(k/j - 1)], j > k$$

con condición inicial $\hat{x}(k/k)$

La matriz de ganancia es

$$K(k, j) = p(j)L(k, j - 1)\Phi^T(j, j - 1)H^T(j)\Pi(j)^{-1}$$

donde

$$L(k, j) = L(k, j - 1)\Phi^T(j, j - 1)[I - p(j)K(j)H(j)]^T$$

siendo I la matriz identidad de dimensión apropiada.

La expresiones de $\Pi(j)$, $D(j)$ y $P(j/j - 1)$ están dadas en el apartado **a** de esta relación de problemas.