

### **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.