

• 已知边缘和条件概率求联合概率分布

已知: $p(x) = N(x|u, \lambda^{-1})$ 精度矩阵

$$p(y|x) = N(y|Ax+b, L^{-1})$$

求: $p(y), p(x|y)$

⇒ 类似贝叶斯: $\underbrace{p(x|y)}_{?} = \frac{\overbrace{p(y|x) \cdot p(x)}^{\text{已知}}}{\underbrace{p(y)}_{?}}$

// To do