

ТВиМС. Лекция

Похмелье

15 ноября 2024 г.

$$X = \begin{pmatrix} X_1 \\ X_2 \end{pmatrix}$$

Матрица корреляции

$$\Sigma = \begin{pmatrix} \Sigma_{11} & \Sigma_{12} \\ \Sigma_{21} & \Sigma_{22} \end{pmatrix}$$

$$E(X_1) = 0 \quad E(X_2)$$

$$E(X_1|X_2) = \Sigma_{12}\Sigma_{22}^{-1}X_2$$

$$X_{ij} \in N(\mu_{ij}, \sigma^2)$$

Плотность распределения

$$f(x) = \frac{1}{\sqrt{2\pi\sigma^2}} e^{-\frac{(x-\mu_i)^2}{2\sigma^2}}$$