* 多维正态密度函数

n维随机向量的正态密度函数表示为：

其中

，， ，

|C|为协方差矩阵C的行列式。

多维正态密度函数由其均值m和协方差矩阵C确定，因此可用下式表示：

p(x) ~ N(m, C)