

pearson相关性系数

2016年4月26日 星期二 上午12:09

$$\rho_{X,Y} = \frac{E[XY] - E[X] E[Y]}{\sqrt{E[X^2] - E[X]^2} \sqrt{E[Y^2] - E[Y]^2}}.$$

$$r = \frac{\sum XY - \frac{(\sum X)(\sum Y)}{n}}{\sqrt{\left(\sum X^2 - \frac{(\sum X)^2}{n}\right) \left(\sum Y^2 - \frac{(\sum Y)^2}{n}\right)}}$$

<http://www.stat.wmich.edu/s216/book/node122.html>