

前面我们介绍了随机变量的数学期望和方差，对于多维随机变量，反映分量之间关系的数字特征中，最重要的，就是本讲要讨论的

协方差和相关系数



若 $Var(X)$, $Var Y$ 存在, 则

$$Var(X \pm Y) = Var(X) + Var(Y) \pm 2E[(X - E(X))(Y - E(Y))]$$

若随机变量 X , Y **相互独立**, 它们的方差都存在, 则 $X \pm Y$ 的方差也存在, 且

$$Var(X \pm Y) = Var(X) + Var(Y)$$



§ 3 协方差、相关系数

协方差

设二维随机变量 (X, Y) , 它的分量的数学期望为 $E(X), E(Y)$, 若 $E[(X-E(X))(Y-E(Y))]$ 存在, 则称它为 X, Y 的协方差, 记为 $Cov(X, Y)$, 即

$$Cov(X, Y) = E[(X-E(X))(Y-E(Y))]$$



计算

(1) 若二维**离散型**随机变量 (X, Y) 的联合分布律为

$$p_{ij} = P(X = x_i, Y = y_j), \quad i, j = 1, 2, \dots$$

且 $Cov(X, Y)$ 存在, 则

$$Cov(X, Y) = \sum_{i,j} (x_i - E(X))(y_j - E(Y)) p_{ij}$$



若二维连续型随机变量 (X, Y) 的联合概率密度为 $f(x, y)$, 且 $Cov(X, Y)$ 存在, 则

$$\begin{aligned} Cov(X, Y) \\ = \int_{-\infty}^{\infty} \int_{-\infty}^{\infty} (x - E(X))(y - E(Y))f(x, y)dxdy \end{aligned}$$

(2)

$$Cov(X, Y) = E(XY) - E(X)E(Y)$$



$$\begin{aligned}
Cov(X,Y) &= E\{[X-E(X)][Y-E(Y)]\} \\
&= E\{XY - XE(Y) - YE(X) + E(X)E(Y)\} \\
&= E(XY) - E(X)E(Y) - E(Y)E(X) + E(X)E(Y) \\
&= E(XY) - E(X)E(Y)
\end{aligned}$$

即

$$Cov(X,Y) = E(XY) - E(X)E(Y)$$

可见，若 X 与 Y 独立， $Cov(X,Y) = 0$.



例1 已知 X, Y 的联合分布为

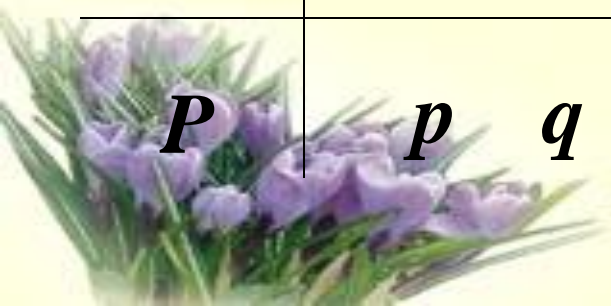
p_{ij} $X \backslash Y$	1	0
1	p	0
0	0	q

$0 < p < 1$
 $p + q = 1$

求 $\text{cov}(X, Y)$

解

X	1	0	Y	1	0	XY	1	0
P	p	q	P	p	q	P	p	q



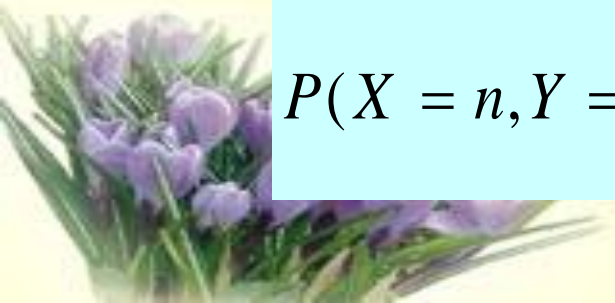
例2 设 (X,Y) 的联合分布律为

$$P(X = n, Y = m) = \frac{\lambda^n p^m (1-p)^{n-m}}{m! (n-m)!} e^{-\lambda}$$

其中

$$\lambda > 0, 0 < p < 1, n = 0, 1, 2, \dots, m = 0, 1, 2, \dots, n$$

求 $Cov(X,Y)$.


$$P(X = n, Y = m) = \frac{\lambda^n}{n!} e^{-\lambda} \cdot \binom{n}{m} p^m (1-p)^{n-m}$$

$$E(g(X, Y)) = \sum_{i=1}^{\infty} \sum_{j=1}^{\infty} g(x_i, y_j) p_{ij}$$

解: $P(X = n, Y = m) = \frac{\lambda^n}{n!} e^{-\lambda} \cdot \binom{n}{m} p^m (1-p)^{n-m}$

$$\begin{aligned} E(XY) &= \sum_{n=0}^{\infty} \sum_{m=0}^n mn \cdot \frac{\lambda^n}{n!} e^{-\lambda} \cdot \binom{n}{m} p^m (1-p)^{n-m} \\ &= \sum_{n=0}^{\infty} n \cdot \frac{\lambda^n}{n!} e^{-\lambda} \sum_{m=0}^n m \binom{n}{m} p^m (1-p)^{n-m} \end{aligned}$$

$$= p \sum_{n=0}^{\infty} n^2 \cdot \frac{\lambda^n}{n!} e^{-\lambda}$$

$$= p\lambda(\lambda + 1)$$

二项分布
B(n, p) 期望

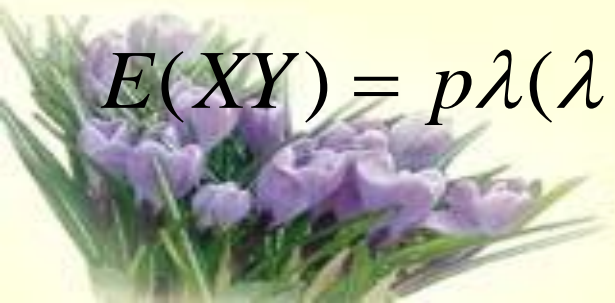


$$E(X) = \sum_{i=1}^{\infty} \sum_{j=1}^{\infty} x_i p_{ij}$$

$$\begin{aligned} E(X) &= \sum_{n=0}^{\infty} \sum_{m=0}^n n \cdot \frac{\lambda^n}{n!} e^{-\lambda} \cdot \binom{n}{m} p^m (1-p)^{n-m} \\ &= \sum_{n=0}^{\infty} n \frac{\lambda^n}{n!} e^{-\lambda} \sum_{m=0}^n \binom{n}{m} p^m (1-p)^{n-m} = \sum_{n=0}^{\infty} n \cdot \frac{\lambda^n}{n!} e^{-\lambda} = \lambda \end{aligned}$$

$$\begin{aligned} E(Y) &= \sum_{n=0}^{\infty} \sum_{m=0}^n m \frac{\lambda^n}{n!} e^{-\lambda} \cdot \binom{n}{m} p^m (1-p)^{n-m} \\ &= \sum_{n=0}^{\infty} \frac{\lambda^n}{n!} e^{-\lambda} \sum_{m=0}^n m \binom{n}{m} p^m (1-p)^{n-m} = p \sum_{n=0}^{\infty} n \frac{\lambda^n}{n!} e^{-\lambda} = p\lambda \end{aligned}$$

$$\begin{aligned} E(XY) &= p\lambda(\lambda + 1), \quad \text{Cov}(X, Y) = E(XY) - E(X)E(Y) \\ &= p\lambda(\lambda + 1) - p\lambda^2 = p\lambda \end{aligned}$$



简单性质

$$(1) \quad \text{Cov}(X, a) = 0$$

$$(2) \quad \text{Cov}(X, Y) = \text{Cov}(Y, X)$$

$$(3) \quad \text{Cov}(X, X) = \text{Var}(X)$$

$$(4) \quad \text{Cov}(aX, bY) = ab \text{Cov}(X, Y) \quad a, b \text{ 是常数}$$

$$(5) \quad \text{Cov}(X_1 + X_2, Y) = \text{Cov}(X_1, Y) + \text{Cov}(X_2, Y)$$



(6) 随机变量和的方差与协方差的关系

$$\text{Var}(X+Y) = \text{Var}(X) + \text{Var}(Y) + 2\text{Cov}(X, Y)$$

$$\text{Var}\left(\sum_{i=1}^n X_i\right) = \sum_{i=1}^n \text{Var}(X_i) + 2 \sum_{i < j} \text{Cov}(X_i, X_j)$$

若 X_1, X_2, \dots, X_n 两两独立,, 上式化为

$$\text{Var}\left(\sum_{i=1}^n X_i\right) = \sum_{i=1}^n \text{Var}(X_i)$$



性质7. 设随机变量 X 和 Y 的期望和方差都存在, 且 $DX>0$, $DY>0$, 则

$$[Cov(X,Y)]^2 \leq D(X)D(Y)$$

其中等号成立当且仅当 X 与 Y 有严格的线性关系 (即存在常数 a 和 b , 使得 $P\{Y=aX+b\}=1$ 成立)

证明: 对任意的实数 t , 有

$$D(tX + Y) = t^2 D(X) + D(Y) + 2t Cov(X, Y)$$

令 $g(t) = t^2 D(X) + 2Cov(X, Y)t + D(Y)$ 为关于 t 的二次三项式。

由方差的性质知 $g(t) \geq 0$, 故判别式小于或等于零, 即有

$$\Delta = [2Cov(X, Y)]^2 - 4D(X)D(Y) \leq 0$$

$$\therefore [Cov(X, Y)]^2 \leq D(X)D(Y)$$



若 $[Cov(X,Y)]^2 = D(X)D(Y)$

此时 $t^2 D(X) + 2Cov(X,Y)t + D(Y) = 0$

有唯一的根, 记为 t_0 , 即 $g(t_0)=0$

所以有 $D(t_0X + Y) = 0$

所以有 $P\{t_0X + Y = E(t_0X + Y)\} = 1$ 即 $P\{Y = -t_0X + E(t_0X + Y)\} = 1$

取 $a = -t_0, b = E(t_0X + Y)$ 有 $P\{Y = aX + b\} = 1$ 成立。



$$g(t) = D(tX + Y) = t^2 D(X) + D(Y) + 2t \text{Cov}(X, Y)$$

反之，若存在常数 a 和 b ，使得 $P\{Y=aX+b\}=1$ 成立

则有 $P\{-aX+Y=b\}=1$

由方差的性质知 $D(-aX+Y)=0$ 即 $g(-a)=0$

所以有 $\Delta = [2\text{Cov}(X, Y)]^2 - 4D(X)D(Y) = 0$

即 $[\text{Cov}(X, Y)]^2 = D(X)D(Y)$



例3 设 (X,Y) 的联合密度函数为

$$f(x, y) = \frac{1}{2\pi\sigma^2} e^{-\frac{(x^2 + y^2)}{2\sigma^2}}$$

求 $Cov(X+Y, X-Y)$

解：由已知条件有

$X \sim N(0, \sigma^2), Y \sim N(0, \sigma^2)$ 且 (X,Y) 相互独立

$$Cov(X+Y, X-Y) = Cov(X, X) - Cov(X, Y) + Cov(Y, X) - Cov(Y, Y)$$

$$= Var(X) - Var(Y) = 0$$



例4 (配对问题)。将 n 只球(编号为 $1\sim n$ 号)随机放进 n 个盒子(编号为 $1\sim n$ 号)中去, 一个盒子只装一只球。若一只球装入与球同号的盒子中, 称为一个配对。记 X 为总配对数, 求 EX, DX 。

解: 设 $X_i = \begin{cases} 1, & \text{第 } i \text{ 号球放入第 } i \text{ 号盒子} \\ 0, & \text{第 } i \text{ 号球未放入第 } i \text{ 号盒子} \end{cases}, i = 1, 2, \dots, n$

则配对总数 $X = X_1 + X_2 + \dots + X_n$

且对任意 i 有 $P\{X_i = 1\} = \frac{1 \times (n-1)!}{n!} = \frac{1}{n}$ $P\{X_i = 0\} = 1 - \frac{1}{n}$

所以由0—1分布的性质得 $EX_i = \frac{1}{n}$, $DX_i = \frac{1}{n}(1 - \frac{1}{n}) = \frac{n-1}{n^2}$



于是有 $EX = E(X_1 + X_2 + \cdots + X_n) = EX_1 + EX_2 + \cdots + EX_n = n \cdot \frac{1}{n} = 1$

另外, 当 $i \neq j$ 时, $P\{X_i X_j = 1\} = P\{X_i = 1, X_j = 1\} = \frac{1 \times (n-2)!}{n!} = \frac{1}{n(n-1)}$
 $P\{X_i X_j = 0\} = 1 - P\{X_i X_j = 1\} = 1 - \frac{1}{n(n-1)}$

所以 $E(X_i X_j) = 1 \times P\{X_i X_j = 1\} = \frac{1}{n(n-1)}$



从而可得

$$\text{Cov}(X_i, X_j) = E(X_i X_j) - EX_i EX_j = \frac{1}{n(n-1)} - \frac{1}{n} \times \frac{1}{n} = \frac{1}{n^2(n-1)}$$

所以 $DX = D\left(\sum_{i=1}^n X_i\right) = \sum_{i=1}^n DX_i + 2 \sum_{1 \leq i < j \leq n} \text{Cov}(X_i, X_j)$

$$= \sum_{i=1}^n \frac{n-1}{n^2} + 2 \sum_{1 \leq i < j \leq n} \frac{1}{n^2(n-1)} = n \frac{n-1}{n^2} + 2C_n^2 \frac{1}{n^2(n-1)} = 1$$



例5 设随机变量 $X_1, X_2, \dots, X_n (n > 1)$ 独立同分布, 且它们共同的方差为 $\sigma^2 > 0$, 令 $\bar{X} = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n X_i, Y_1 = X_1 - \bar{X}, Y_n = X_n - \bar{X}$. 求 $D(Y_1)$ 以及 $\text{Cov}(Y_1, Y_n)$

解: 由方差的性质可得:

$$D(\bar{X}) = D\left(\frac{1}{n} \sum_{i=1}^n X_i\right) = \frac{1}{n^2} \sum_{i=1}^n DX_i = \frac{1}{n^2} \sum_{i=1}^n \sigma^2 = \frac{\sigma^2}{n}$$

又易知

$$\text{Cov}(X_1, \bar{X}) = \text{Cov}\left(X_1, \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n X_i\right) = \text{Cov}\left(X_1, \frac{1}{n} X_1\right) = \frac{1}{n} D(X_1) = \frac{\sigma^2}{n}$$



同理有 $Cov(X_n, \bar{X}) = \frac{\sigma^2}{n}$

所以

$$\begin{aligned} D(Y_1) &= D(X_1 - \bar{X}) \\ &= D(X_1) + D(\bar{X}) - 2Cov(X_1, \bar{X}) \\ &= \sigma^2 + \frac{\sigma^2}{n} - \frac{2\sigma^2}{n} = \frac{n-1}{n}\sigma^2 \end{aligned}$$



由协方差的性质可得

$$\begin{aligned} \text{Cov}(Y_1, Y_n) &= \text{Cov}(X_1 - \bar{X}, X_n - \bar{X}) = \text{Cov}(X_1, X_n) - \text{Cov}(X_1, \bar{X}) - \text{Cov}(X_n, \bar{X}) + \text{Cov}(\bar{X}, \bar{X}) \\ &= 0 - \text{Cov}(X_1, \bar{X}) - \text{Cov}(X_n, \bar{X}) + D(\bar{X}) = 0 - \frac{\sigma^2}{n} - \frac{\sigma^2}{n} + \frac{\sigma^2}{n} = -\frac{\sigma^2}{n} \end{aligned}$$



协方差的大小在一定程度上反映了 X 和 Y 相互间的关系，但它还受 X 与 Y 本身度量单位的影响.例如：

$$Cov(kX, kY) = k^2 Cov(X, Y)$$

为了克服这一缺点，对协方差进行标准化，这就引入了相关系数。





休息片刻继续下一讲

相关系数

若二维随机变量 (X, Y) 的分量的方差

$Var(X), Var(Y)$ 都存在, 且 $Var(X) > 0,$

$Var(Y) > 0,$

则称

$$\rho_{XY} = \frac{Cov(X, Y)}{\sqrt{Var(X)Var(Y)}}$$

为随机变量 X 和 Y 的相关系数.

在不致引起混淆时, 记 ρ_{XY} 为 ρ .



若 $\rho_{XY}=0$ 则称 X, Y 不相关;

若 $\rho_{XY}>0$ 称 X, Y 正相关;

若 $\rho_{XY}<0$ 则称 X, Y 负相关



例6 设 $X \sim N(0,4)$, $Y \sim \pi(2)$, $\rho_{XY} = 1/2$,
 $E(X+Y)^2$

解：由已知条件有

$$E(X) = 0, D(X) = 4, \quad E(X^2) = D(X) + [E(X)]^2 = 4$$

$$E(Y) = D(Y) = 2, \quad E(Y^2) = D(Y) + [E(Y)]^2 = 6$$

$$Cov(X, Y) = \rho_{XY} \sqrt{Var(X)Var(Y)} = \frac{1}{2} \sqrt{4 \cdot 2} = \sqrt{2}$$

$$E(XY) = Cov(X, Y) + E(X)E(Y) = \sqrt{2}$$

所以 $E[(X+Y)^2] = E(X^2) + 2E(XY) + E(Y^2)$

$$= 4 + 2\sqrt{2} + 6 = 10 + 2\sqrt{2}$$



例7 设 $X \sim U[0, 2\pi]$, $Y = \cos(X)$, 求 ρ_{XY}



例8 设 (X,Y) 在圆域

$$D = \{(x, y); x^2 + y^2 \leq r^2\} (r > 0)$$

上服从均匀分布，判断 X,Y 是否不相关,是否独立。

解：由题意 (X,Y) 的联合密度函数

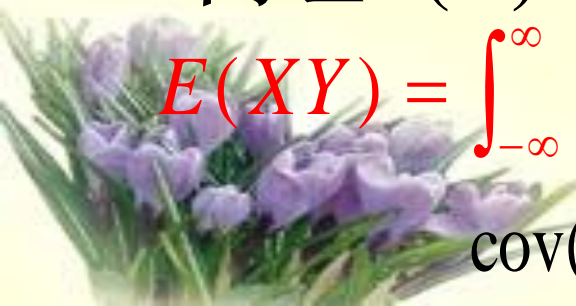
$$f(x, y) = \begin{cases} \frac{1}{\pi r^2} & (x, y) \in D \\ 0 & \text{其他} \end{cases}$$

$$E(X) = \int_{-\infty}^{\infty} \int_{-\infty}^{\infty} x f(x, y) dx dy = \iint_{x^2+y^2 \leq r^2} x \frac{1}{\pi r^2} dx dy = 0$$

同理 $E(Y)=0$

$$E(XY) = \int_{-\infty}^{\infty} \int_{-\infty}^{\infty} xy f(x, y) dx dy = \iint_{x^2+y^2 \leq r^2} xy \frac{1}{\pi r^2} dx dy = 0$$

$$\text{cov}(X, Y) = E(XY) - E(X)E(Y) = 0$$

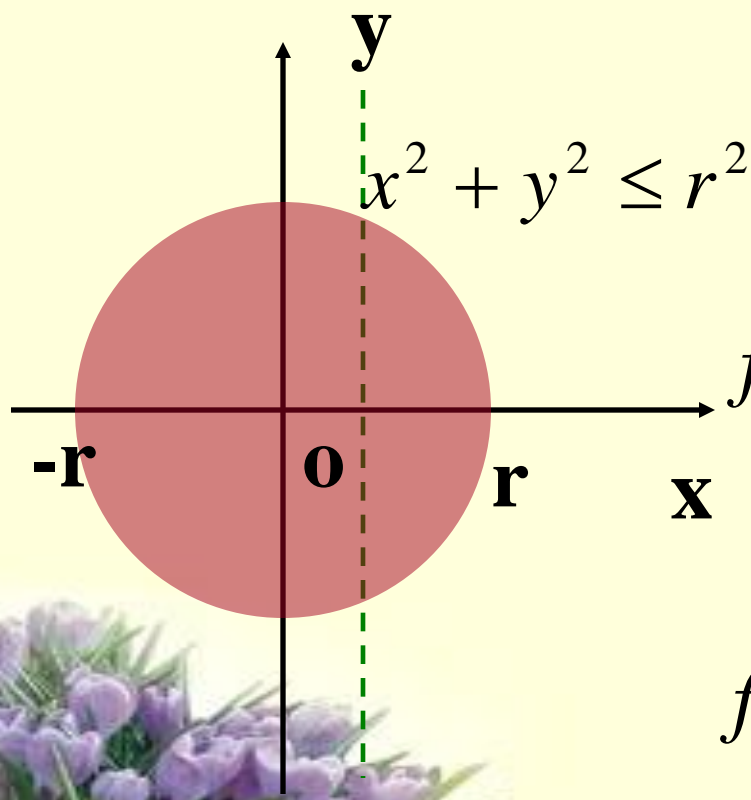


$$f(x, y) = \begin{cases} \frac{1}{\pi r^2} & (x, y) \in D \\ 0 & \text{其他} \end{cases}$$

若 $|x| \leq r$

$$f_X(x) = \int_{-\infty}^{\infty} f(x, y) dy \quad f_X(x) = \int_{-\sqrt{r^2-x^2}}^{\sqrt{r^2-x^2}} \frac{1}{\pi r^2} dy$$

$$= \frac{2\sqrt{r^2-x^2}}{\pi r^2}$$



$$f_X(x) = \begin{cases} \frac{2\sqrt{r^2-x^2}}{\pi r^2} & |x| \leq r \\ 0 & \text{其他} \end{cases}$$

$$f_Y(y) = \begin{cases} \frac{2\sqrt{r^2-y^2}}{\pi r^2} & |y| \leq r \\ 0 & \text{其他} \end{cases}$$

$$D = \{(x, y) : x^2 + y^2 \leq r^2\}$$

$$f(x, y) \neq f_X(x)f_Y(y), \quad (x, y) \in D$$

X, Y 不独立



例9 设 (X, Y) 服从二维正态分布

$$N(\mu_1, \sigma_1^2; \mu_2, \sigma_2^2, \rho)$$

求 X 和 Y 的相关系数



$$\begin{aligned}
 \text{Cov}(X, Y) &= E[(X - \mu_1)(Y - \mu_2)] \\
 &= \int_{-\infty}^{\infty} \int_{-\infty}^{\infty} (x - \mu_1)(y - \mu_2) f(x, y) dx dy \\
 &= \int_{-\infty}^{\infty} \int_{-\infty}^{\infty} \frac{1}{2\pi\sigma_1\sigma_2\sqrt{1-\rho^2}} (x - \mu_1)(y - \mu_2) \exp\left\{-\frac{1}{2(1-\rho^2)}\right. \\
 &\quad \left.[(\frac{x - \mu_1}{\sigma_1})^2 - 2\rho(\frac{x - \mu_1}{\sigma_1})(\frac{y - \mu_2}{\sigma_2}) + (\frac{y - \mu_2}{\sigma_2})^2]\right\} dx dy
 \end{aligned}$$

$$\text{令 } u = \frac{x - \mu_1}{\sigma_1}, v = \frac{y - \mu_2}{\sigma_2}$$



$$= \frac{\sigma_1 \sigma_2}{2\pi \sqrt{1-\rho^2}} \int_{-\infty}^{\infty} \int_{-\infty}^{\infty} uv \cdot \exp\left\{-\frac{1}{2(1-\rho^2)}(u^2 - 2\rho uv + v^2)\right\} dv du$$

$$u^2 - 2\rho uv + v^2$$

$$= (v - \rho u)^2 + (1 - \rho^2)u^2$$

$$= \frac{\sigma_1 \sigma_2}{2\pi \sqrt{1-\rho^2}} \int_{-\infty}^{\infty} \int_{-\infty}^{\infty} uv \exp\left\{-\frac{1}{2(1-\rho^2)}\right.$$

$$\left. [(v - \rho u)^2 + (1 - \rho^2)u^2] \right\} dv du$$



$$= \frac{\sigma_1 \sigma_2}{2\pi \sqrt{1-\rho^2}} \int_{-\infty}^{\infty} \int_{-\infty}^{\infty} uv \exp \left\{ -\frac{1}{2(1-\rho^2)} [(v-\rho u)^2 + (1-\rho^2)u^2] \right\} dv du$$

$$\text{令 } t = \frac{1}{\sqrt{1-\rho^2}} (v-\rho u), \quad u = u$$

$$= \frac{\sigma_1 \sigma_2}{2\pi} \int_{-\infty}^{\infty} \int_{-\infty}^{\infty} u(\rho u + \sqrt{1-\rho^2} t) \exp(-\frac{1}{2} t^2) \exp(-\frac{1}{2} u^2) dt du$$

$$= \rho \sigma_1 \sigma_2 \left(\int_{-\infty}^{\infty} u^2 \frac{1}{\sqrt{2\pi}} \exp(-\frac{1}{2} u^2) du \right) \left(\int_{-\infty}^{\infty} \frac{1}{\sqrt{2\pi}} \exp(-\frac{1}{2} t^2) dt \right) \\ + \sqrt{1-\rho^2} \sigma_1 \sigma_2 \left(\int_{-\infty}^{\infty} u \frac{1}{\sqrt{2\pi}} \exp(-\frac{1}{2} u^2) du \right) \left(\int_{-\infty}^{\infty} t \frac{1}{\sqrt{2\pi}} \exp(-\frac{1}{2} t^2) dt \right)$$

$$= \rho \sigma_1 \sigma_2$$



独立与相关的关系

(1) X, Y 相互独立 \longrightarrow X, Y 不相关



X, Y 不相关	\longleftrightarrow	$\rho_{XY} = 0$
	\longleftrightarrow	$\text{cov}(X, Y) = 0$
	\longleftrightarrow	$E(XY) = E(X)E(Y)$
	\longleftrightarrow	$\text{Var}(X \pm Y) = \text{Var}(X) + \text{Var}(Y)$

(2) 若 X, Y 服从**二维正态分布**,

X, Y 相互独立 \longleftrightarrow X, Y 不相关



相关系数的性质

$$(1) \quad |\rho| \leq 1$$

$$(2) \quad |\rho| = 1 \iff \text{存在常数 } a, b (b \neq 0), \text{ 使 } P\{Y = a + bX\} = 1.$$

$\rho_{XY} = 1$ 的充要条件是, $P(Y = a + bX) = 1 (b > 0)$

这时称 **X 与 Y 完全正相关**;

$\rho_{XY} = -1$ 的充要条件是, $P(Y = a + bX) = 1 (b < 0)$
这时称 **X 与 Y 完全负相关**。



相关系数的意义

它是用来刻画 X, Y 线性相关程度的一个量。

若 $|\rho|$ 的值越接近于 1, X 与 Y 的线性相关程度越高。

若 $|\rho|$ 的值越接近于 0, X 与 Y 的线性相关程度越弱。



矩

设二维随机变量 (X, Y) , k, l 为非负整数。

若 $E(X^k)$ 存在, 则称它为 X 的 k 阶原点矩, 记作 m_k , 即

$$m_k = E(X^k)$$

若 $E(X - E(X))^k$ 存在, 则称它为 X 的 k 阶中心矩, 记作 c_k ,

$$\text{即 } c_k = E(X - E(X))^k$$

若 $E(X^k Y^l)$ 存在, 则称它为 X 和 Y 的 (k, l) 阶混合矩,

$$\text{记作 } m_{kl}, \text{ 即 } m_{kl} = E(X^k Y^l)$$

若 $E[(X - E(X))^k (Y - E(Y))^l]$ 存在,

则称它为 X 和 Y 的 (k, l) 阶混合中心矩, 记作 c_{kl} , 即

$$c_{kl} = E[(X - E(X))^k (Y - E(Y))^l]。$$



关于矩有下述结论： 设 k 为正整数。

(1) 若 $E(X^k)$ 存在， 则对小于 k 的一切非负整数 l ，
 $E(X^l)$ 存在.

(2) 原点矩与中心矩可相互表示。



例10 求标准正态分布的各阶矩.

$$\text{设 } X \sim N(0,1), \quad m_k = c_k = E(X^k) = \frac{1}{\sqrt{2\pi}} \int_{-\infty}^{\infty} x^k e^{-\frac{x^2}{2}} dx$$

若 k 为奇数, $c_k = 0$

若 k 为偶数,

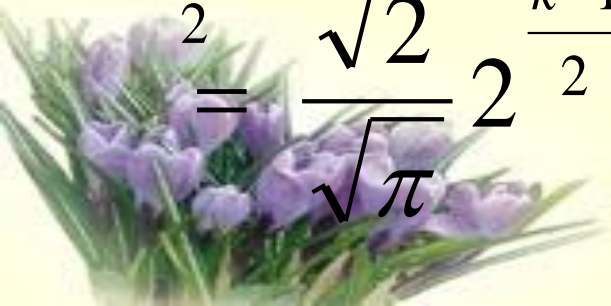
$$\Gamma(x) = \int_0^{\infty} e^{-t} t^{x-1} dt, \quad x > 0$$

$$\Gamma(n+1) = n!$$

$$\Gamma\left(\frac{n}{2}\right) = 1 \cdot 3 \cdot 5 \cdots (n-2) \cdot 2^{-(n-1)/2} \sqrt{\pi}$$

$$c_k = \frac{1}{\sqrt{2\pi}} \int_{-\infty}^{\infty} x^k e^{-\frac{x^2}{2}} dx = \frac{\sqrt{2}}{\sqrt{\pi}} \int_0^{\infty} x^k e^{-\frac{x^2}{2}} dx$$

$$\begin{aligned} & \stackrel{\frac{x^2}{2}=t}{=} \frac{\sqrt{2}}{\sqrt{\pi}} 2^{\frac{k-1}{2}} \int_0^{\infty} t^{\frac{k-1}{2}} e^{-t} dt = \frac{\sqrt{2}}{\sqrt{\pi}} 2^{\frac{k-1}{2}} \Gamma\left(\frac{k+1}{2}\right) \\ & = 1 \cdot 3 \cdot 5 \cdots (k-1) \end{aligned}$$



第四章

作业3 : 36,40,42,44,45





稍事休息