

Lec-15. 协方差与相关系数、矩

主讲教师：吴利苏 (wulisu@sdust.edu.cn)

主 页：wulisu.cn

本次课内容

1. 协方差及相关系数

2. 矩、协方差矩阵

$$D(X+Y) = D(X)+D(Y)+2E\{[X - E(X)][Y - E(Y)]\}$$

- 若 X, Y 相互独立,
则 $E\{[X - E(X)][Y - E(Y)]\} = 0$.

$$D(X+Y) = D(X) + D(Y).$$

- $E\{[X - E(X)][Y - E(Y)]\}$ 定义为 **协方差**.

协方差和相关系数

定义

$$\text{Cov}(X, Y) = E\{[X - E(X)][Y - E(Y)]\}$$

称为随机变量 X 与 Y 的**协方差**.

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

称为 X 与 Y 的**相关系数**或**标准协方差**.

本节公式

- 协方差的计算公式:

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

- 相关系数

$$\rho_{XY} = \frac{\text{Cov}(X, Y)}{\sqrt{D(X)D(Y)}}.$$

- $D(X + Y) = D(X) + D(Y) + 2\text{Cov}(X, Y).$

$Cov(X, Y)$ 反应了 X 与 Y 的线性相关性.

- 当 $Cov(X, Y) > 0$ 时, X 与 Y 正相关.

$Cov(X, Y)$ 反应了 X 与 Y 的线性相关性.

- 当 $Cov(X, Y) > 0$ 时, X 与 Y 正相关.
- 当 $Cov(X, Y) < 0$ 时, X 与 Y 负相关.

$Cov(X, Y)$ 反应了 X 与 Y 的线性相关性.

- 当 $Cov(X, Y) > 0$ 时, X 与 Y 正相关.
- 当 $Cov(X, Y) < 0$ 时, X 与 Y 负相关.
- 当 $Cov(X, Y) = 0$ 时, X 与 Y (线性) 不相关.

$Cov(X, Y)$ 反应了 X 与 Y 的线性相关性.

- 当 $Cov(X, Y) > 0$ 时, X 与 Y 正相关.
- 当 $Cov(X, Y) < 0$ 时, X 与 Y 负相关.
- 当 $Cov(X, Y) = 0$ 时, X 与 Y (线性) 不相关.
- 若 X 与 Y 相互独立, 则 $Cov(X, Y) = 0$.

$Cov(X, Y)$ 反应了 X 与 Y 的线性相关性.

- 当 $Cov(X, Y) > 0$ 时, X 与 Y 正相关.
- 当 $Cov(X, Y) < 0$ 时, X 与 Y 负相关.
- 当 $Cov(X, Y) = 0$ 时, X 与 Y (线性) 不相关.
- 若 X 与 Y 相互独立, 则 $Cov(X, Y) = 0$.
 - 相互独立 \Rightarrow 不相关;

$Cov(X, Y)$ 反应了 X 与 Y 的线性相关性.

- 当 $Cov(X, Y) > 0$ 时, X 与 Y 正相关.
- 当 $Cov(X, Y) < 0$ 时, X 与 Y 负相关.
- 当 $Cov(X, Y) = 0$ 时, X 与 Y (线性) 不相关.
- 若 X 与 Y 相互独立, 则 $Cov(X, Y) = 0$.
 - 相互独立 \Rightarrow 不相关;
 - 相互独立 \nLeftarrow 不相关;

例 (反例)

(X, Y) 的分布律为

$Y \backslash X$	-2	-1	1	2	$P\{Y = j\}$
1	0	$\frac{1}{4}$	$\frac{1}{4}$	0	$\frac{1}{2}$
4	$\frac{1}{4}$	0	0	$\frac{1}{4}$	$\frac{1}{2}$
$P\{X = i\}$	$\frac{1}{4}$	$\frac{1}{4}$	$\frac{1}{4}$	$\frac{1}{4}$	1

则 X 与 Y 不相关, 且不相互独立.

例 (反例)

(X, Y) 的分布律为

$Y \backslash X$	-2	-1	1	2	$P\{Y = j\}$
1	0	$\frac{1}{4}$	$\frac{1}{4}$	0	$\frac{1}{2}$
4	$\frac{1}{4}$	0	0	$\frac{1}{4}$	$\frac{1}{2}$
$P\{X = i\}$	$\frac{1}{4}$	$\frac{1}{4}$	$\frac{1}{4}$	$\frac{1}{4}$	1

则 X 与 Y 不相关, 且不相互独立.

实际上, X 与 Y 非线性相关: $Y = X^2$.

协方差的性质

性质 (双线性)

1. $Cov(X, Y) = Cov(Y, X)$.
2. $Cov(X, X) = D(X)$.
3. $Cov(aX, bY) = ab \cdot Cov(X, Y)$, $a, b \in \mathbb{R}$.
4. $Cov(X_1 + X_2, Y) = Cov(X_1, Y) + Cov(X_2, Y)$.

协方差的性质

性质 (双线性)

1. $Cov(X, Y) = Cov(Y, X).$
2. $Cov(X, X) = D(X).$
3. $Cov(aX, bY) = ab \cdot Cov(X, Y), a, b \in \mathbb{R}.$
4. $Cov(X_1 + X_2, Y) = Cov(X_1, Y) + Cov(X_2, Y).$
5. $Cov(X + C, Y) = Cov(X, Y).$

例

计算 $Cov(3X + 2Y, 2X)$.

性质

取标准化变量

$$X^* = \frac{X - E(X)}{\sqrt{D(X)}}, Y^* = \frac{Y - E(Y)}{\sqrt{D(Y)}}.$$

则 $\rho_{XY} = \text{Cov}(X^*, Y^*)$.

性质

取标准化变量

$$X^* = \frac{X - E(X)}{\sqrt{D(X)}}, Y^* = \frac{Y - E(Y)}{\sqrt{D(Y)}}.$$

则 $\rho_{XY} = Cov(X^*, Y^*)$.

证:

$$\begin{aligned} Cov(X^*, Y^*) &= Cov\left(\frac{X - E(X)}{\sqrt{D(X)}}, \frac{Y - E(Y)}{\sqrt{D(Y)}}\right) \\ &= \frac{Cov(X, Y)}{\sqrt{D(X)}\sqrt{D(Y)}} \\ &= \rho_{XY}. \end{aligned}$$



相关系数的意义

- 考虑以 X 的线性函数 $a + bX$ 近似表示 Y .
接近程度如何衡量?

相关系数的意义

- 考虑以 X 的线性函数 $a + bX$ 近似表示 Y . 接近程度如何衡量?
- 均方误差

$$e = E[(Y - (a + bX))^2]$$

e 越小, $a + bX$ 与 Y 近似程度越好. 确定 a 与 b 的值, 使得 e 达到最小.

$$\begin{aligned}
 e &= E[(Y - (a + bX))^2] \\
 &= E(Y^2) + b^2 E(X^2) + a^2 \\
 &\quad - 2bE(XY) + 2abE(X) - 2aE(Y)
 \end{aligned}$$

将 e 分别关于 a, b 求偏导数, 并令它们等于零.

$$\begin{cases} \frac{\partial e}{\partial a} = 2a + 2bE(X) - 2E(Y) = 0, \\ \frac{\partial e}{\partial b} = 2bE(X^2) - 2E(XY) + 2aE(X) = 0 \end{cases}$$

得

$$\begin{cases} b_0 = \frac{\text{Cov}(X, Y)}{D(X)}, \\ a_0 = E(Y) - b_0 E(X) = E(Y) - E(X) \frac{\text{Cov}(X, Y)}{D(X)} \end{cases}$$

则

$$e_{\min} = E([Y - (a_0 + b_0 X)]^2) = (1 - \rho_{XY}^2) D(Y).$$

$$e_{\min} = \min E[(Y - (a + bX))^2] = (1 - \rho_{XY}^2)D(Y).$$

ρ_{XY} 是一个表示 X, Y 之间线性紧密程度.

- 当 $|\rho_{XY}|$ 较大时, e 较小, 表明 X, Y 的线性关系较紧密.
- 当 $|\rho_{XY}|$ 较小时, e 较大, 表明 X, Y 的线性关系较差.
- 当 $\rho_{XY} = 0$ 时, X, Y 不相关.

性质

下列说法等价 (TFAE) :

1. X, Y 不相关.
2. $\rho_{XY} = 0$.
3. $Cov(X, Y) = 0$.
4. $E(XY) = E(X)E(Y)$.

相关系数的性质

定理

(1.) $|\rho_{XY}| \leq 1;$

(2.) $|\rho_{XY}| = 1 \Leftrightarrow \exists a, b \text{ s.t.}$

$$P\{Y = a + bX\} = 1.$$

相关系数的性质

定理

(1.) $|\rho_{XY}| \leq 1;$

(2.) $|\rho_{XY}| = 1 \Leftrightarrow \exists a, b \text{ s.t.}$

$$P\{Y = a + bX\} = 1.$$

证明: (1) 由 $E[Y - (a_0 + b_0X)]^2$ 及 $D(Y)$ 的非负性

$$1 - \rho_{XY}^2 \geq 0 \Rightarrow |\rho_{XY}| \leq 1.$$

(2) "⇒" 若 $|\rho_{XY}| = 1$, 则

$$\begin{aligned} D(Y - (a_0 + b_0X)) &= E\{[Y - (a_0 + b_0X)]^2\} \\ &\quad - \{E(Y - (a_0 + b_0)X)\}^2 \\ &= 0 - \{E(Y - (a_0 + b_0)X)\}^2 \end{aligned}$$

因此

$$D(Y - (a_0 + b_0X)) = 0$$

$$E(Y - (a_0 + b_0X)) = 0.$$

由方差的性质 4, 知

$$P\{Y = a_0 + b_0X\} = 1.$$

" \Leftarrow " 若 $\exists a^*, b^*$, s.t $P\{Y = a^* + b^*X\} = 1$, 即

$$P\{Y - (a^* + b^*X) = 0\} = 1.$$

于是, $E\{[Y - (a^* + b^*X)]^2\} = 0$.

$$\begin{aligned} 0 = E\{[Y - (a^* + b^*X)]^2\} &\geq \min E\{[Y - (a + bX)]^2\} \\ &= E\{Y - (a_0 + b_0X)^2\} \\ &= (1 - \rho_{XY}^2)D(Y) \end{aligned}$$

故 $|\rho_{XY}| = 1$. □

例

设 $(X, Y) \sim N(\mu_1, \mu_2, \sigma_1^2, \sigma_2^2, \rho)$, 求 X 与 Y 的相关系数.

例

设 $(X, Y) \sim N(\mu_1, \mu_2, \sigma_1^2, \sigma_2^2, \rho)$, 求 X 与 Y 的相关系数.

解: $\forall x, y \in \mathbb{R}$,

$$f(x, y) = \frac{1}{2\pi\sigma_1\sigma_2\sqrt{1-\rho^2}} \exp\left(-\frac{1}{2(1-\rho^2)} \left[\frac{(x-\mu_1)^2}{\sigma_1^2} - \frac{2\rho(x-\mu_1)(y-\mu_2)}{\sigma_1\sigma_2} + \frac{(y-\mu_2)^2}{\sigma_2^2}\right]\right)$$

$$f_X(x) = \frac{1}{\sqrt{2\pi}\sigma_1} e^{-\frac{(x-\mu_1)^2}{2\sigma_1^2}}, \quad f_Y(y) = \frac{1}{\sqrt{2\pi}\sigma_2} e^{-\frac{(y-\mu_2)^2}{2\sigma_2^2}}$$

则 $E(X) = \mu_1$, $E(Y) = \mu_2$, $D(X) = \sigma_1^2$, $D(Y) = \sigma_2^2$.

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

令 $t = \frac{1}{\sqrt{1-\rho^2}} \left(\frac{y-\mu_2}{\sigma_2} - \rho \frac{x-\mu_1}{\sigma_1} \right)$, $u = \frac{x-\mu_1}{\sigma_1}$, 则]

$$\begin{aligned} \text{Cov}(X, Y) &= \frac{1}{2\pi} \int_{-\infty}^{+\infty} \int_{-\infty}^{+\infty} (\sigma_1\sigma_2\sqrt{1-\rho^2}tu + \rho\sigma_1\sigma_2u^2) e^{-\frac{u^2+t^2}{2}} dt du \\ &= \frac{\rho\sigma_1\sigma_2}{2\pi} \left(\int_{-\infty}^{+\infty} u^2 e^{-\frac{u^2}{2}} du \right) \left(\int_{-\infty}^{+\infty} e^{-\frac{t^2}{2}} dt \right) \\ &\quad + \frac{\sigma_1\sigma_2\sqrt{1-\rho^2}}{2\pi} \left(\int_{-\infty}^{+\infty} ue^{-\frac{u^2}{2}} du \right) \left(\int_{-\infty}^{+\infty} te^{-\frac{t^2}{2}} dt \right) \\ &= \frac{\rho\sigma_1\sigma_2}{2\pi} \sqrt{2\pi} \cdot \sqrt{2\pi} + 0 = \rho\sigma_1\sigma_2, \end{aligned}$$

即 $\text{Cov}(X, Y) = \rho\sigma_1\sigma_2$, 所以

$$\rho_{XY} = \frac{\text{Cov}(X, Y)}{\sqrt{D(X)}\sqrt{D(Y)}} = \rho.$$

□

- 二维正态分布参数 ρ 就是相关系数.
- 二维正态分布中,

X 与 Y 相互独立 $\Leftrightarrow X$ 与 Y 不相关($\rho = 0$).

例

设 $X \sim N(1, 3^2)$, $Y \sim N(0, 4^2)$, $\rho_{XY} = -\frac{1}{2}$. 令
 $Z = \frac{X}{3} + \frac{Y}{2}$.

- (1) 求 Z 的数学期望和方差.
- (2) 求 X 与 Z 的相关系数.
- (3) 问 X 与 Z 是否相互独立, 为什么?

解: (1) $E(X) = 1, E(Y) = 0,$

$$D(X) = 9, D(Y) = 16.$$

$$E(Z) = \frac{1}{3}E(X) + \frac{1}{2}E(Y) = \frac{1}{3}.$$

$$D(Z) = D\left(\frac{X}{3}\right) + D\left(\frac{Y}{2}\right) + 2Cov\left(\frac{X}{3}, \frac{Y}{2}\right) = 3.$$

$$\begin{aligned} (2) \quad Cov(X, Z) &= Cov\left(X, \left(\frac{X}{3} + \frac{Y}{2}\right)\right) \\ &= \frac{1}{3}Cov(X, X) + \frac{1}{2}Cov(X, Y) = 0. \end{aligned}$$

$$\rho_{XZ} = 0.$$

(3) X, Z 为正态分布, $\rho_{XZ} = 0 \Rightarrow X$ 与 Z 相互独立. □

矩

- $D(X) = E(X^2) - [E(X)]^2.$
- $Cov(X, Y) = E(XY) - E(X)E(Y).$
- 本质上计算期望!

矩

- $D(X) = E(X^2) - [E(X)]^2.$
- $Cov(X, Y) = E(XY) - E(X)E(Y).$
- 本质上计算期望!

矩

设 X, Y 为随机变量,

- 若

$$E(X^k), \quad k = 1, 2, \dots$$

存在, 则称它为 X 的 k 阶原点矩, 简称 k 阶矩.

设 X, Y 为随机变量,

- 若

$$E(X^k), \quad k = 1, 2, \dots$$

存在, 则称它为 X 的 k 阶原点矩, 简称 k 阶矩.

- 若

$$E\{[X - E(X)]^k\}$$

存在, 称它为 X 的 k 阶中心距.

设 X, Y 为随机变量,

- 若

$$E(X^k), \quad k = 1, 2, \dots$$

存在, 则称它为 X 的 k 阶原点矩, 简称 k 阶矩.

- 若

$$E\{[X - E(X)]^k\}$$

存在, 称它为 X 的 k 阶中心矩.

- 若

$$E(X^k Y^l)$$

存在, 称它为 X 和 Y 的 $k + l$ 阶混合矩.

设 X, Y 为随机变量,

- 若

$$E(X^k), \quad k = 1, 2, \dots$$

存在, 则称它为 X 的 k 阶原点矩, 简称 k 阶矩.

- 若

$$E\{[X - E(X)]^k\}$$

存在, 称它为 X 的 k 阶中心矩.

- 若

$$E(X^k Y^l)$$

存在, 称它为 X 和 Y 的 $k + l$ 阶混合矩.

- 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.

矩

1. $E(X)$ 是 X 的一阶原点矩,
 $D(X)$ 为二阶中心距,
 $Cov(X, Y)$ 是 X 和 Y 的二阶混合中心距.

矩

1. $E(X)$ 是 X 的一阶原点矩,
 $D(X)$ 为二阶中心距,
 $Cov(X, Y)$ 是 X 和 Y 的二阶混合中心距.
2. 以上数字特征都是随机变量函数的数学期望.

矩

1. $E(X)$ 是 X 的一阶原点矩,
 $D(X)$ 为二阶中心矩,
 $Cov(X, Y)$ 是 X 和 Y 的二阶混合中心矩.
2. 以上数字特征都是随机变量函数的数学期望.
3. 在实际应用中, 高于 4 阶的矩很少用.
三阶中心矩 $E\{[X - E(X)]^3\}$ 主要用来衡量随机变量的分布是否有偏.
四阶中心矩 $E\{[X - E(X)]^4\}$ 主要用来衡量随机变量的分布在均值附近的陡峭程度.

协方差矩阵

二维随机变量 (X_1, X_2) 的协方差矩阵为

$$C = \begin{pmatrix} D(X_1) & Cov(X_1, X_2) \\ Cov(X_2, X_1) & D(X_2) \end{pmatrix}.$$

协方差矩阵

n 维随机变量 (X_1, \dots, X_n) 的协方差矩阵为

$$C = \begin{pmatrix} D(X_1) & Cov(X_1, X_2) & \cdots & Cov(X_1, X_n) \\ Cov(X_2, X_1) & D(X_2) & \cdots & Cov(X_2, X_n) \\ \vdots & \vdots & & \vdots \\ Cov(X_n, X_1) & Cov(X_n, X_2) & \cdots & D(X_n) \end{pmatrix}.$$

- 协方差矩阵 $C = C^T$ 为对称非负定矩阵.
- 作用：刻画高维随机变量.
比如定义 n 维正态分布.

二维正态分布

二维正态分布 (X, Y) 的概率密度:

$$\begin{aligned} f(x, y) &= \frac{1}{2\pi\sigma_1\sigma_2\sqrt{1-\rho^2}} \exp \left[-\frac{1}{2(1-\rho^2)} \left(\frac{(x-\mu_1)^2}{\sigma_1^2} - \frac{2\rho(x-\mu_1)(y-\mu_2)}{\sigma_1\sigma_2} + \frac{(y-\mu_2)^2}{\sigma_2^2} \right) \right] \\ &= \frac{1}{2\pi\sigma_1\sigma_2\sqrt{1-\rho^2}} \exp \left[-\frac{1}{2(1-\rho^2)} (x-\mu_1, y-\mu_2) \begin{pmatrix} \frac{1}{\sigma_1^2} & -\frac{\rho}{\sigma_1\sigma_2} \\ -\frac{\rho}{\sigma_1\sigma_2} & \frac{1}{\sigma_2^2} \end{pmatrix} \begin{pmatrix} x-\mu_1 \\ y-\mu_2 \end{pmatrix} \right] \\ &= \frac{1}{2\pi\sigma_1\sigma_2\sqrt{1-\rho^2}} \exp \left[-\frac{1}{2} (x-\mu_1, y-\mu_2) \frac{\begin{pmatrix} \sigma_2^2 & -\rho\sigma_1\sigma_2 \\ -\rho\sigma_1\sigma_2 & \sigma_1^2 \end{pmatrix}}{(1-\rho^2)\sigma_1^2\sigma_2^2} \begin{pmatrix} x-\mu_1 \\ y-\mu_2 \end{pmatrix} \right] \\ &= \frac{1}{2\pi\sqrt{\det C}} \exp \left[-\frac{1}{2} (x-\mu_1, y-\mu_2) C^{-1} \begin{pmatrix} x-\mu_1 \\ y-\mu_2 \end{pmatrix} \right] \end{aligned}$$

其中 $C = \begin{pmatrix} \sigma_1^2 & \rho\sigma_1\sigma_2 \\ \rho\sigma_1\sigma_2 & \sigma_2^2 \end{pmatrix}$ 为协方差矩阵, $\det C = (1-\rho^2)\sigma_1^2\sigma_2^2$.

n 维正态分布

n 维正态分布 $\mathbf{X} = (X_1, \dots, X_n)^T$ 的概率密度:

$$f(\mathbf{X}) = \frac{1}{(2\pi)^{n/2} \sqrt{\det C}} \exp \left[-\frac{1}{2} (\mathbf{X} - \boldsymbol{\mu})^T C^{-1} (\mathbf{X} - \boldsymbol{\mu}) \right]$$

其中 $\boldsymbol{\mu} = (E(X_1), \dots, E(X_n))^T$, C 为协方差矩阵.

n 维正态分布的性质

1. n 维正态随机变量 $\mathbf{X} = (X_1, \dots, X_n)^T, n \geq 1$, 其任意子向量 $(X_{i_1}, \dots, X_{i_k})^T (1 \leq k \leq n)$ 均服从 k 维正态分布.

例如: $\mathbf{X} = (X_1, X_2, X_3)^T$ 为 3 维正态随机变量, 则 $(X_1, X_2)^T, (X_1, X_3)^T, (X_2, X_3)^T$ 均为二维正态随机变量.

特别地, 每一个分量 X_i 都是一维正态变量.
反之, 若 X_i 均为一维正态变量, 且相互独立, 则 $\mathbf{X} = (X_1, \dots, X_n)^T$ 为 n 维正态随机变量.

n 维正态分布的性质

2. n 维随机变量

$\mathbf{X} = (X_1, X_2, \dots, X_n)^T, n \geq 1$, 服从 n 维正态分布 $\Leftrightarrow X_1, X_2, \dots, X_n$ 的任意线性组合

$$l_0 + l_1 X_1 + l_2 X_2 + \dots + l_n X_n$$

均服从一维正态分布, 其中 l_1, l_2, \dots, l_n 不全为 0.

例如: $\mathbf{X} = (X_1, X_2, X_3)^T$ 为 3 维正态随机变量, 则 $3X_1 - X_2, 2X_1 + 4X_3 + 1, X_2 - 3X_1 - X_3 - 2$ 均为一维正态随机变量.

3. n 维正态随机变量

$\mathbf{X} = (X_1, \dots, X_n)^T$, $n \geq 1$, 若 Y_1, \dots, Y_k 均为 X_i 的线性函数, 则 $(Y_1, Y_2, \dots, Y_k)^T$ 也服从 k 维正态分布.

这一性质称为正态变量的线性变换不变性.

例如: $\mathbf{X} = (X_1, X_2, X_3)^T$ 为 3 维正态随机变量, 则 $(3X_1 - X_2, 2X_1 + 4X_3 + 1, X_2 - 3X_1 - X_3 - 2, X_2)^T$ 服从 4 维正态分布.

4. 设 $\mathbf{X} = (X_1, \dots, X_n)^T$, $n \geq 1$ 服从 n 维正态分布, TFAE:

1. X_1, X_2, \dots, X_n 相互独立;
2. X_1, X_2, \dots, X_n 两两不相关;
3. \mathbf{X} 的协方差矩阵为对角矩阵.

例

设 $(X, Y) \sim N(0, 1, 1, 4, -\frac{1}{2})$, 求:

(1) $D(2X - Y)$,

(2) $P\{2X > Y\}$,

(3) (Z_1, Z_2) 的分布, $Z_1 = X + Y, Z_2 = X - Y$.