

协方差与协方差系数的公式?

定义若 $\rho_{XY}=0$,则称X与Y不相关。

即 $\rho_{XY}=0$ 的充分必要条件是 $\text{COV}(X,Y)=0$,亦即不相关和协方差为零是等价的。定理设 ρ_{XY} 是随机变量X和Y的相关系数,则有 (1) $|\rho_{XY}| \leq 1$; (2) $|\rho_{XY}|=1$ 充分必要条件为 $P\{Y=aX$

$b\}=1$, (a,b为常数,a $\neq 0$) 定义设X和Y是随机变量,若 $E(X^k),k=1,2,$

股票和基金的协方差是多少?

??实际上,基函数可以有其它不同类型,相当于用不同类型基函数去分解信号(图象)。余弦变换是其中常用的一种。pp 设离散序列

,为一离散序列,根据下式延拓成偶对称序列:其中。是关于为中心的偶对称序列如下图所示。(图)pp 以代入在范围内作点的傅立叶变换:pp

余弦变换的变换核为:表示成矩阵形式为:(其中各列模为1)pp

定义偶余弦变换(EDCT)和逆变换为:pp

二维余弦变换:二维余弦变换具有可分离性:表示成矩阵形式:pp

余弦变换可以利用傅立叶变换实现:将

延拓为:则有:借助傅立叶变换计算余弦变换的步骤:1)把延拓成,长度为;2)求的点的FFT;3)对各项乘上对应的因子;4)取实部,并乘上因子;5)取的前项,即为的余弦变换。