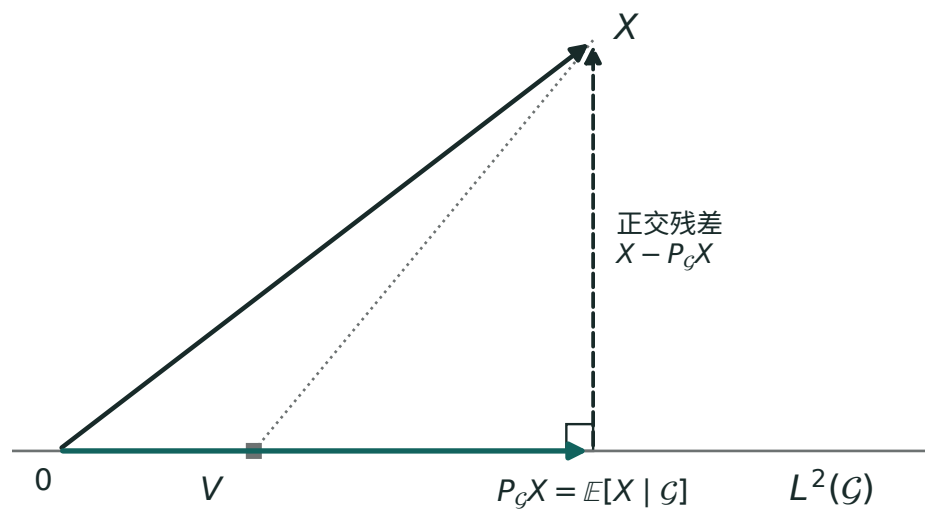


条件期望：最佳平方预测与正交残差

$$\|X - V\|_2^2 = \|X - P_{\mathcal{G}}X\|_2^2 + \|P_{\mathcal{G}}X - V\|_2^2$$



这是 Hilbert 空间的抽象几何示意；图画是二维的，不表示所有随机变量构成二维空间。