

$$\hat{S}_P = \frac{1}{I-1} \sum_{i=0}^{I-1} \begin{bmatrix} ZCR(i) - mw1 \\ BMW(i) - mw2 \end{bmatrix} [(ZCR(i) - mw1) (BMW(i) - mw2)] \quad (11)$$

【0033】採用された変数DIFM1及びDIFM2 * 【0034】
を使うと、次のように示すことができる。 * 【数17】

$$\hat{S}_P = \frac{1}{I-1} \sum_{i=0}^{I-1} \begin{bmatrix} DIFM1 \\ DIFM2 \end{bmatrix} [DIFM1 \quad DIFM2] \quad (12)$$

$$\hat{S}_P = \frac{1}{I-1} \sum_{i=0}^{I-1} \begin{bmatrix} DIFM1^2 & (DIFM1 \cdot DIFM2) \\ (DIFM2 \cdot DIFM1) & DIFM2^2 \end{bmatrix}$$

(13)

【0035】ここでマトリクス要素S₁₁、S₁₂、
S₂₁、及びS₂₂を入れて、次のように計算される。 * 【0036】
【数18】