

Korrelationskoefficient (normeret covarians)

- dimensionsløs
- ligger mellem -1 og 1

$$\rho_{XY} \stackrel{\text{def}}{=} \frac{\text{COV}(X, Y)}{\sigma_X \cdot \sigma_Y} = \frac{\sigma_{XY}}{\sigma_X \cdot \sigma_Y}$$

$$-1 \leq \rho_{XY} \leq 1$$

måler i % Lineær afhængighed mellem X og Y

Jo tættere på ± 1 , jo tættere vil vil punkterne ligge på grafen.