

À savoir

On appelle coefficient de corrélation linéaire le réel r défini par :

$$r = \frac{\sum_{i=1}^N x_i y_i - N \bar{x} \bar{y}}{\sqrt{\left(\sum_{i=1}^N x_i^2 - N \bar{x}^2 \right) \left(\sum_{i=1}^N y_i^2 - N \bar{y}^2 \right)}} = \frac{\text{cov}(x, y)}{\sigma_x \sigma_y}.$$