

Spørgsmål 19) Afsnit 6.3 kovarians og korrelation. fra den generelle formel for variansen af summen af to stokastiske variable sidste resultat i boksen side 430 fås

$$\text{Var}(X + Y) = \text{Var}(X) + \text{Var}(Y) + 2\text{Cov}(X, Y) = 1 + 2 + 2\rho \cdot 1 \cdot \sqrt{2}$$

Korrekt svar er 4, procent korrekte var 42 %