



O que aprendemos?

Nesta aula, aprendemos:

- Que a **variância** e a **covariância** são classificadas como medidas de dispersão, e como calculá-las. Para a variância, usamos a fórmula $\sigma^2(x) = \sum (a_i - E(x))^2 / n$, Para a covariância, : $Cov(X, Y) = E(X*Y) - E(X)*E(Y)$.
- O que é **correlação** e sua fórmula para cálculo:

$$Corr(X, Y) = Cov(X, Y) / \sigma(X)\sigma(Y)$$

[COPIAR CÓDIGO](#)

- A fazer o cálculo do **índice Beta** de um ativo

$$\beta(\text{Ativo}) = Cov(\text{Ativo}, \text{Mercado}) / \sigma^2(\text{Mercado})$$

[COPIAR CÓDIGO](#)