

## 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  $\sigma^2(x) = \sum(ai - E(x))^2 / n$ , Para a covariância, :  $Cov(X,Y) = E(X*Y) - E(X)*E(Y)$  .
- O que é **correlação** e sua fórmula para cálculo:

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

[COPIAR CÓDIGO](#)

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

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

[COPIAR CÓDIGO](#)