

A Metodologia Quantitativa da Correlação é utilizada para quantificar o grau de associação entre dois ativos, avaliando se seus movimentos de preço ocorrem de forma convergente ou divergente. Esse indicador estatístico permite identificar padrões de co-movimentação, auxiliando na análise de diversificação e no gerenciamento de risco das carteiras de investimento.

CORRELAÇÃO POSIÇÃO 31/12/2024

(1) Período de análise: Últimos 6 meses

(2) Correlação dos retornos diários