

MATRIZ DE CORRELAÇÃO

Período		Estratégia																																													
Ativo	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27	28	29	30	31	32	33	34	35	36	37	38	39	40	41	42	43	44	45	46	47
1 - CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍT...	1,00	0,78	0,68	0,40	0,67	0,49	-0,12	-0,12	-0,12	-0,12	-0,12	-0,09	-0,12	-0,12	-0,12	-0,12	-0,12	-0,12	-0,12	0,63	0,08	0,64	0,62	0,56	0,59	0,61	0,62	0,64	-0,16	-0,23	-0,17	0,38	0,23	0,61	0,35	1,00	-0,01	0,65	0,01	0,64	0,63	0,61	-0,15	-0,16	0,00	0,23	
2 - CAIXA BRASIL GESTÃO EST...	0,78	1,00	0,80	0,16	0,93	0,86	-0,18	-0,18	-0,18	-0,18	-0,18	-0,14	-0,18	-0,18	-0,18	-0,18	-0,18	-0,18	-0,15	0,86	0,16	0,73	0,74	0,64	0,63	0,74	0,71	0,75	-0,29	-0,42	-0,32	0,30	0,22	0,71	0,30	0,78	-0,05	0,78	-0,04	0,73	0,75	0,72	0,70	-0,27	-0,19	0,00	0,22
3 - CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍT...	0,68	0,80	1,00	0,02	0,68	0,55	-0,33	-0,33	-0,33	-0,33	-0,33	-0,29	-0,33	-0,33	-0,33	-0,33	-0,33	-0,33	-0,31	0,64	0,15	0,56	0,60	0,51	0,55	0,62	0,58	0,61	-0,17	-0,27	-0,23	0,45	0,17	0,59	0,34	0,67	-0,12	0,99	-0,12	0,56	0,61	0,61	0,60	-0,16	-0,13	0,00	0,17
4 - BB PREVIDENCIÁRIO REND...	0,40	0,16	0,02	1,00	0,22	0,04	-0,09	-0,09	-0,09	-0,09	-0,09	-0,06	-0,09	-0,09	-0,09	-0,09	-0,09	-0,09	0,02	0,12	-0,03	0,12	0,09	0,09	0,07	0,02	0,08	0,07	0,01	0,04	0,05	-0,13	0,08	0,07	0,11	0,40	0,03	0,03	0,06	0,12	0,09	0,04	0,03	0,03	-0,07	0,00	0,08
5 - CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚ...	0,67	0,93	0,68	0,22	1,00	0,87	-0,18	-0,18	-0,18	-0,18	-0,18	-0,14	-0,18	-0,18	-0,18	-0,18	-0,18	-0,18	-0,15	0,86	0,17	0,61	0,62	0,51	0,52	0,62	0,58	0,63	-0,34	-0,39	-0,30	0,21	0,13	0,60	0,26	0,66	0,00	0,67	-0,02	0,61	0,63	0,60	0,58	-0,31	-0,21	0,00	0,13
6 - ITAÚ INSTITUCIONAIS LEG...	0,49	0,86	0,55	0,04	0,87	1,00	-0,09	-0,09	-0,09	-0,09	-0,09	-0,07	-0,09	-0,09	-0,09	-0,09	-0,09	-0,09	-0,05	0,80	0,16	0,60	0,62	0,52	0,44	0,61	0,55	0,61	-0,35	-0,48	-0,36	0,06	0,10	0,59	0,21	0,49	-0,04	0,53	-0,01	0,60	0,62	0,58	0,57	-0,33	-0,15	0,00	0,09
7 - NTN-B 150830 (7,720000%)	-0,12	-0,18	-0,33	-0,09	-0,18	-0,09	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	0,93	1,00	1,00	0,99	1,00	1,00	1,00	0,81	-0,08	0,08	-0,18	-0,22	-0,23	-0,21	-0,22	-0,24	-0,24	0,04	0,11	0,08	-0,24	-0,11	-0,22	-0,17	-0,12	0,28	-0,33	0,03	-0,18	-0,23	-0,23	-0,23	0,04	0,10	0,00	-0,12
8 - NTN-B 150535 (6,275000%)	-0,12	-0,18	-0,33	-0,09	-0,18	-0,09	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	0,93	1,00	1,00	0,99	1,00	1,00	1,00	0,81	-0,08	0,08	-0,18	-0,22	-0,23	-0,21	-0,22	-0,24	-0,24	0,04	0,11	0,08	-0,24	-0,11	-0,22	-0,17	-0,12	0,28	-0,33	0,03	-0,18	-0,23	-0,23	-0,23	0,04	0,10	0,00	-0,12
9 - NTN-B 150830 (6,460000%)	-0,12	-0,18	-0,33	-0,09	-0,18	-0,09	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	0,93	1,00	1,00	0,99	1,00	1,00	1,00	0,81	-0,08	0,08	-0,18	-0,22	-0,23	-0,21	-0,22	-0,24	-0,24	0,04	0,11	0,08	-0,24	-0,11	-0,22	-0,17	-0,12	0,28	-0,33	0,03	-0,18	-0,23	-0,23	-0,23	0,04	0,10	0,00	-0,12
10 - NTN-B 150830 (7,500000...	-0,12	-0,18	-0,33	-0,09	-0,18	-0,09	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	0,93	1,00	1,00	0,99	1,00	1,00	1,00	0,81	-0,08	0,08	-0,18	-0,22	-0,23	-0,21	-0,22	-0,24	-0,24	0,04	0,11	0,08	-0,24	-0,11	-0,22	-0,17	-0,12	0,28	-0,33	0,03	-0,18	-0,23	-0,23	-0,23	0,04	0,10	0,00	-0,12
11 - NTN-B 150828 (6,760000...	-0,12	-0,18	-0,33	-0,09	-0,18	-0,09	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	0,93	1,00	1,00	0,99	1,00	1,00	1,00	0,81	-0,08	0,08	-0,18	-0,22	-0,23	-0,21	-0,22	-0,24	-0,24	0,04	0,11	0,08	-0,24	-0,11	-0,22	-0,17	-0,12	0,28	-0,33	0,03	-0,18	-0,23	-0,23	-0,23	0,04	0,10	0,00	-0,12
12 - NTN-B 150830 (7,680000...	-0,09	-0,14	-0,29	-0,06	-0,14	-0,07	0,93	0,93	0,93	0,93	0,93	1,00	0,93	0,93	0,91	0,93	0,93	0,93	0,94	-0,06	0,08	-0,14	-0,18	-0,17	-0,18	-0,19	-0,21	-0,20	0,03	0,09	0,06	-0,20	-0,10	-0,18	-0,16	-0,09	0,23	-0,29	0,03	-0,14	-0,19	-0,19	-0,18	0,03	0,08	0,00	-0,12
13 - NTN-B 150832 (7,770000...	-0,12	-0,18	-0,33	-0,09	-0,18	-0,09	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	0,93	1,00	1,00	0,99	1,00	1,00	1,00	0,81	-0,08	0,08	-0,18	-0,22	-0,23	-0,21	-0,22	-0,24	-0,24	0,04	0,11	0,08	-0,24	-0,11	-0,22	-0,17	-0,12	0,28	-0,33	0,03	-0,18	-0,23	-0,23	-0,23	0,04	0,10	0,00	-0,12
14 - NTN-B 150828 (6,720000...	-0,12	-0,18	-0,33	-0,09	-0,18	-0,09	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	0,93	1,00	1,00	0,99	1,00	1,00	1,00	0,81	-0,08	0,08	-0,18	-0,22	-0,23	-0,21	-0,22	-0,24	-0,24	0,04	0,11	0,08	-0,24	-0,11	-0,22	-0,17	-0,12	0,28	-0,33	0,03	-0,18	-0,23	-0,23	-0,23	0,04	0,10	0,00	-0,12
15 - NTN-B 150840 (7,200000...	-0,12	-0,18	-0,33	-0,09	-0,18	-0,09	0,99	0,99	0,99	0,99	0,99	0,91	0,99	0,99	1,00	0,99	0,99	0,99	0,77	-0,08	0,08	-0,19	-0,23	-0,24	-0,21	-0,23	-0,25	-0,25	0,05	0,13	0,10	-0,24	-0,10	-0,23	-0,17	-0,12	0,28	-0,33	0,03	-0,19	-0,24	-0,23	-0,24	0,05	0,11	0,00	-0,11
16 - NTN-B 150840 (7,560000...	-0,12	-0,18	-0,33	-0,09	-0,18	-0,09	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	0,93	1,00	1,00	0,99	1,00	1,00	1,00	0,81	-0,08	0,08	-0,18	-0,22	-0,23	-0,21	-0,22	-0,24	-0,24	0,04	0,11	0,08	-0,24	-0,11	-0,22	-0,17	-0,12	0,28	-0,33	0,03	-0,18	-0,23	-0,23	-0,23	0,04	0,10	0,00	-0,12
17 - NTN-B 150535 (7,370000...	-0,12	-0,18	-0,33	-0,09	-0,18	-0,09	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	0,93	1,00	1,00	0,99	1,00	1,00	1,00	0,81	-0,08	0,08	-0,18	-0,22	-0,23	-0,21	-0,22	-0,24	-0,24	0,04	0,11	0,08	-0,24	-0,11	-0,22	-0,17	-0,12	0,28	-0,33	0,03	-0,18	-0,23	-0,23	-0,23	0,04	0,10	0,00	-0,12
18 - NTN-B 150535 (6,130000...	-0,12	-0,18	-0,33	-0,09	-0,18	-0,09	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	0,93	1,00	1,00	0,99	1,00	1,00	1,00	0,81	-0,08	0,08	-0,18	-0,22	-0,23	-0,21	-0,22	-0,24	-0,24	0,04	0,11	0,08	-0,24	-0,11	-0,22	-0,17	-0,12	0,28	-0,33	0,03	-0,18	-0,23	-0,23	-0,23	0,04	0,10	0,00	-0,12
19 - NTN-B 150535 (7,380000...	-0,12	-0,15	-0,31	0,02	-0,15	-0,05	0,81	0,81	0,81	0,81	0,81	0,94	0,81	0,81	0,77	0,81	0,81	0,81	1,00	-0,08	0,07	-0,13	-0,17	-0,16	-0,19	-0,20	-0,22	-0,20	0,04	0,12	0,12	-0,23	-0,10	-0,18	-0,16	-0,12	0,19	-0,32	0,02	-0,13	-0,18	-0,20	-0,19	0,05	0,10	0,00	-0,11
20 - CAIXA BRASIL MATRIZ FIF...	0,63	0,86	0,64	0,12	0,86	0,80	-0,08	-0,08	-0,08	-0,08	-0,08	-0,06	-0,08	-0,08	-0,08	-0,08	-0,08	-0,08	-0,08	1,00	0,59	0,54	0,54	0,43	0,48	0,55	0,51	0,55	-0,28	-0,40	-0,30	0,24	0,12	0,51	0,19	0,63	0,06	0,63	-0,08	0,54	0,54	0,54	0,51	-0,27	-0,16	0,00	0,12
21 - CAIXA BRASIL FIF RENDA ...	0,08	0,16	0,15	-0,03	0,17	0,16	0,08	0,08	0,08	0,08	0,08	0,08	0,08	0,08	0,08	0,08	0,08	0,08	0,07	0,59	1,00	0,04	0,01	-0,02	0,10	0,03	0,01	0,02	0,00	-0,12	-0,09	0,18	0,03	0,02	-0,06	0,08	0,21	0,15	-0,14	0,04	0,02	0,06	0,04	0,00	0,05	0,00	0,03
22 - FIA CAIXA CONSUMO	0,64	0,73	0,56	0,12	0,61	0,60	-0,18	-0,18	-0,18	-0,18	-0,18	-0,14	-0,18	-0,18	-0,19	-0,18	-0,18	-0,18	-0,13	0,54	0,04	1,00	0,95	0,85	0,81	0,91	0,92	0,95	-0,23	-0,39	-0,30	0,39	0,27	0,89	0,17	0,64	-0,06	0,54	-0,05	1,00	0,96	0,91	0,89	-0,22	-0,12	0,00	0,28
23 - CAIXA SMALL CAPS ATIV...	0,62	0,74	0,60	0,09	0,62	0,62	-0,22	-0,22	-0,22	-0,22	-0,22	-0,18	-0,22	-0,22	-0,23	-0,22	-0,22	-0,22	-0,17	0,54	0,01	0,95	1,00	0,89	0,85	0,93	0,93	0,97	-0,19	-0,43	-0,28	0,43	0,32	0,91	0,18	0,62	-0,07	0,58	-0,10	0,95	1,00	0,93	0,91	-0,17	-0,09	0,00	0,32
24 - FIA CAIXA CONSTRUÇÃO...	0,56	0,64	0,51	0,09	0,51	0,52	-0,23	-0,23	-0,23	-0,23	-0,23	-0,17	-0,23	-0,23	-0,24	-0,23	-0,23	-0,23	-0,16	0,43	-0,02	0,85	0,89	1,00	0,72	0,88	0,85	0,88	-0,26	-0,40	-0,33	0,37	0,21	0,83	0,16	0,56	-0,04	0,49	0,01	0,85	0,88	0,83	0,82	-0,25	-0,15	0,00	0,22
25 - ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FI...	0,59	0,63	0,55	0,07	0,52	0,44	-0,21	-0,21	-0,21	-0,21	-0,21	-0,18	-0,21	-0,21	-0,21	-0,21	-0,21	-0,21	-0,19	0,48	0,10	0,81	0,85	0,72	1,00	0,86	0,90	0,88	0,08	-0,37	-0,18	0,51	0,54	0,87	0,13	0,59	0,00	0,54	-0,13	0,81	0,85	0,90	0,87	0,10	0,07	0,00	0,54
26 - CAIXA EXPERT VINCI VAL...	0,61	0,74	0,62	0,02	0,62	0,61	-0,22	-0,22	-0,22	-0,22	-0,22	-0,19	-0,22	-0,22	-0,23	-0,22	-0,22	-0,22	-0,20	0,55	0,03	0,91	0,93	0,88	0,86	1,00	0,96	0,97	-0,23	-0,45	-0,34	0,42	0,30	0,97	0,20	0,61	-0,05	0,59	-0,07	0,91	0,93	0,98	0,96	-0,22	-0,14	0,00	0,30
27 - ITAÚ AÇÕES MOMENTO ...	0,62	0,71	0,58	0,08	0,58	0,55	-0,24	-0,24	-0,24	-0,24	-0,24	-0,21	-0,24	-0,24	-0,25	-0,24	-0,24	-0,24	-0,22	0,51	0,01	0,92	0,93	0,85	0,90	0,96	1,00	0,97	-0,21	-0,44	-0,33	0,44	0,34	0,95	0,18	0,62	-0,07	0,55	-0,06	0							

Ativo	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27	28	29	30	31	32	33	34	35	36	37	38	39	40	41	42	43	44	45	46	47
44 - Global BDRX	-0,15	-0,27	-0,16	0,03	-0,31	-0,33	0,04	0,04	0,04	0,04	0,04	0,03	0,04	0,04	0,05	0,04	0,04	0,04	0,05	-0,27	0,00	-0,22	-0,17	-0,25	0,10	-0,22	-0,19	-0,19	0,99	0,37	0,44	0,09	0,67	-0,20	-0,12	-0,15	0,02	-0,16	-0,29	-0,22	-0,17	-0,17	-0,16	1,00	0,73	0,00	0,66
45 - MSCI ACWI (BRL)	-0,16	-0,19	-0,13	-0,07	-0,21	-0,15	0,10	0,10	0,10	0,10	0,10	0,08	0,10	0,10	0,11	0,10	0,10	0,10	0,10	-0,16	0,05	-0,12	-0,09	-0,15	0,07	-0,14	-0,13	-0,11	0,72	0,23	0,27	0,00	0,59	-0,13	-0,17	-0,16	0,00	-0,14	-0,28	-0,12	-0,09	-0,10	-0,08	0,73	1,00	0,00	0,60
46 - Não Se Aplica	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	1,00	0,00	0,00	
47 - S&P 500 (USD)	0,23	0,22	0,17	0,08	0,13	0,09	-0,12	-0,12	-0,12	-0,12	-0,12	-0,12	-0,12	-0,12	-0,11	-0,12	-0,12	-0,12	-0,11	0,12	0,03	0,28	0,32	0,22	0,54	0,30	0,34	0,33	0,64	-0,11	0,05	0,31	0,99	0,29	0,00	0,23	0,01	0,15	-0,14	0,27	0,33	0,34	0,33	0,66	0,60	0,00	1,00

(1) Período de análise: Últimos 6 meses
(2) Correlação dos retornos diários

Legenda de Cores:

