

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

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		
1 - FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1	0,98	0,99	0,75	0,87	-0,2	-0,5	0,12	0,12	0,12	0,12	0,12	0,33	-0,1	-0,2	0,2	0,54	0,56	0,56	0,46	0,51	0,54	0,55	-0,3	-0,5	-0,5	0,24	0,2	0,36	1	0,02	0,98	0,74	-0	0,86	0,54	0,58	0,5	0,46	-0,3	-0	0	0,2		
2 - FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,98	1	0,97	0,78	0,88	-0,1	-0,5	0,11	0,11	0,11	0,11	0,11	0,33	-0,1	-0,2	0,17	0,59	0,6	0,6	0,47	0,55	0,57	0,6	-0,3	-0,5	-0,5	0,25	0,2	0,37	0,98	0,01	0,95	0,76	-0,1	0,86	0,59	0,61	0,53	0,49	-0,3	-0,1	0	0,21		
3 - FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,99	0,97	1	0,76	0,85	-0,2	-0,4	0,11	0,11	0,11	0,11	0,11	0,31	-0,1	-0,2	0,21	0,52	0,53	0,54	0,45	0,5	0,52	0,54	-0,3	-0,5	-0,5	0,24	0,18	0,36	0,99	0,03	0,99	0,75	-0	0,82	0,52	0,55	0,48	0,44	-0,3	-0	0	0,18		
4 - FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,75	0,78	0,76	1	0,73	0,07	-0,6	-0	-0	-0	-0	-0	-0,19	0,11	-0,1	0,18	0,65	0,64	0,67	0,49	0,6	0,64	0,65	-0,4	-0,5	-0,5	0,23	0,05	0,35	0,76	0,05	0,75	1	-0	0,6	0,65	0,66	0,55	0,51	-0,4	-0,2	0	0,05		
5 - BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,87	0,88	0,85	0,73	1	-0,1	-0,4	0,05	0,05	0,05	0,05	0,05	0,36	-0	-0,1	0,17	0,62	0,62	0,64	0,54	0,6	0,63	0,64	-0,4	-0,5	-0,5	0,25	0,21	0,4	0,87	-0,1	0,82	0,72	-0,2	0,92	0,62	0,64	0,57	0,52	-0,3	-0,1	0	0,22		
6 - FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	-0,2	-0,1	-0,2	0,07	-0,1	1	-0,2	0,02	0,02	0,02	0,02	0,02	-0	0,73	0,52	-0	-0,1	-0	-0	-0,1	-0,1	-0,1	-0,1	-0,1	-0,1	0,12	0,09	0,12	-0,1	-0,1	-0,1	-0,2	0,15	-0,2	0,09	0,08	-0,2	-0,1	-0	-0,1	-0,1	0,1	0,02	0	-0,1
7 - ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	-0,5	-0,5	-0,4	-0,6	-0,4	-0,2	1	-0	-0	-0	-0	-0	-0,4	-0,2	-0,1	0,01	-0,4	-0,4	-0,4	-0,3	-0,4	-0,4	-0,4	0,27	0,35	0,38	-0,1	-0	-0,2	-0,5	0,04	-0,4	-0,6	-0	-0,4	-0,4	-0,4	-0,4	-0,4	0,28	0,25	0	0	-0	
8 - NTN-B 150535 (6,275000%)	0,12	0,11	0,11	-0	0,05	0,02	-0	1	1	1	1	1	0,22	0,04	-0	0,01	-0,1	-0,1	-0,1	-0,1	-0,1	-0,1	-0,1	-0,1	0,02	-0	-0	-0,1	-0,1	-0,1	0,12	0,38	0,08	-0	0,4	0,12	-0,1	-0,1	-0,1	-0,2	-0	-0,1	0	-0,1	
9 - NTN-B 150830 (6,460000%)	0,12	0,11	0,11	-0	0,05	0,02	-0	1	1	1	1	1	0,22	0,04	-0	0,01	-0,1	-0,1	-0,1	-0,1	-0,1	-0,1	-0,1	-0,1	0,02	-0	-0	-0,1	-0,1	-0,1	0,12	0,38	0,08	-0	0,4	0,12	-0,1	-0,1	-0,1	-0,2	-0	-0,1	0	-0,1	
10 - NTN-B 150535 (6,130000%)	0,12	0,11	0,11	-0	0,05	0,02	-0	1	1	1	1	1	0,22	0,04	-0	0,01	-0,1	-0,1	-0,1	-0,1	-0,1	-0,1	-0,1	-0,1	0,02	-0	-0	-0,1	-0,1	-0,1	0,12	0,38	0,08	-0	0,4	0,12	-0,1	-0,1	-0,1	-0,2	-0	-0,1	0	-0,1	
11 - NTN-B 150828 (6,760000%)	0,12	0,11	0,11	-0	0,05	0,02	-0	1	1	1	1	1	0,22	0,04	-0	0,02	-0,1	-0,1	-0,1	-0,1	-0,1	-0,1	-0,1	-0,1	0,02	-0	-0	-0,1	-0,1	-0,1	0,12	0,38	0,08	-0	0,4	0,12	-0,1	-0,1	-0,1	-0,2	-0	-0,1	0	-0,1	
12 - NTN-B 150828 (6,720000%)	0,12	0,11	0,11	-0	0,05	0,02	-0	1	1	1	1	1	0,22	0,04	-0	0,02	-0,1	-0,1	-0,1	-0,1	-0,1	-0,1	-0,1	-0,1	0,02	-0	-0	-0,1	-0,1	-0,1	0,12	0,38	0,08	-0	0,4	0,12	-0,1	-0,1	-0,1	-0,2	-0	-0,1	0	-0,1	
13 - RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	0,33	0,33	0,31	0,19	0,36	-0	-0,4	0,22	0,22	0,22	0,22	0,22	1	0,1	0,07	0,26	0,24	0,32	0,33	0,31	0,32	0,32	0,32	-0,2	-0,2	-0,2	0,05	0,16	0,21	0,33	-0	0,27	0,19	0	0,43	0,24	0,32	0,32	0,3	-0,2	-0	0	0,15		
14 - FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FIXA	-0,1	-0,1	-0,1	0,11	-0	0,73	-0,2	0,04	0,04	0,04	0,04	0,04	0,1	1	0,88	-0	0,03	0,12	0,06	0,03	0,07	0,06	0,05	-0,1	-0,1	-0	-0,1	-0,1	-0	-0,1	0,06	-0,1	0,13	-0,1	-0,1	0,03	0,11	0,03	0,09	-0,1	-0,1	0	-0,1		
15 - CAIXA BRASIL FIF RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO - RESP LIMITADA	-0,2	-0,2	-0,2	-0,1	-0,1	0,52	-0,1	-0	-0	-0	-0	-0	0,07	0,88	1	-0	0	0,08	0,01	0,06	0,05	0,05	0,02	0,01	0,07	0,11	-0,1	-0,1	0,01	-0,2	-0,1	-0,3	-0	-0,2	-0,2	0,01	0,07	0,02	0,07	0	0	0	-0,1		
16 - RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	0,2	0,17	0,21	0,18	0,17	-0	0,01	0,01	0,01	0,01	0,02	0,02	0,26	-0	-0	1	0,2	0,19	0,18	0,28	0,22	0,2	0,21	0	-0,1	-0,1	0,06	0,17	0,13	0,2	-0,2	0,22	0,18	-0	0,13	0,2	0,2	0,24	0,22	0,03	0,17	0	0,18		
17 - FIA CAIXA CONSUMO	0,54	0,59	0,52	0,65	0,62	-0,1	-0,4	-0,1	-0,1	-0,1	-0,1	-0,1	0,24	0,03	0	0,2	1	0,89	0,86	0,78	0,85	0,9	0,94	-0,3	-0,6	-0,5	0,18	0,31	0,5	0,54	-0,1	0,5	0,64	-0,1	0,48	1	0,89	0,87	0,77	-0,3	-0,1	0	0,31		
18 - FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	0,56	0,6	0,53	0,64	0,62	-0	-0,4	-0,1	-0,1	-0,1	-0,1	-0,1	0,32	0,12	0,08	0,19	0,89	1	0,9	0,77	0,87	0,9	0,95	-0,4	-0,6	-0,5	0,15	0,29	0,48	0,56	-0,1	0,5	0,64	-0,1	0,52	0,89	1	0,86	0,8	-0,3	-0,1	0	0,29		
19 - FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	0,56	0,6	0,54	0,67	0,64	-0	-0,4	-0,1	-0,1	-0,1	-0,1	-0,1	0,33	0,06	0,01	0,18	0,86	0,9	1	0,74	0,87	0,9	0,93	-0,4	-0,5	-0,5	0,17	0,19	0,48	0,56	-0,1	0,52	0,66	-0,2	0,53	0,86	0,9	0,82	0,75	-0,4	-0,3	0	0,19		
20 - ITAU AÇÕES DUNAMIS FIF CIC RESPONSABILIDADE LIMITADA	0,46	0,47	0,45	0,49	0,54	-0,1	-0,3	-0,1	-0,1	-0,1	-0,1	-0,1	0,31	0,03	0,06	0,28	0,78	0,77	0,74	1	0,87	0,88	0,84	-0,1	-0,4	-0,3	0,18	0,43	0,64	0,46	-0,2	0,42	0,49	-0,2	0,45	0,79	0,77	0,92	0,85	-0,1	-0	0	0,42		
21 - FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	0,51	0,55	0,5	0,6	0,6	-0,1	-0,4	-0,1	-0,1	-0,1	-0,1	-0,1	0,32	0,07	0,05	0,22	0,85	0,87	0,87	0,87	1	0,95	0,94	-0,3	-0,5	-0,4	0,19	0,25	0,6	0,51	-0,2	0,48	0,6	-0,2	0,49	0,86	0,87	0,96	0,95	-0,3	-0,1	0	0,24		
22 - ITAU AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	0,54	0,57	0,52	0,64	0,63	-0,1	-0,4	-0,1	-0,1	-0,1	-0,1	-0,1	0,32	0,06	0,05	0,2	0,9	0,9	0,9	0,88	0,95	1	0,97	-0,3	-0,5	-0,4	0,21	0,27	0,58	0,54	-0,1	0,5	0,64	-0,2	0,51	0,9	0,91	0,95	0,87	-0,3	-0,1	0	0,25		
23 - FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	0,55	0,6	0,54	0,65	0,64	-0,1	-0,4	-0,1	-0,1	-0,1	-0,1	-0,1	0,32	0,05	0,02	0,21	0,94	0,95	0,93	0,84	0,94	0,97	1	-0,4	-0,6	-0,5	0,2	0,29	0,55	0,55	-0,1	0,51	0,65	-0,1	0,52	0,94	0,96	0,93	0,86	-0,3	-0,2	0	0,28		
24 - FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-0,3	-0,3	-0,3	-0,4	-0,4	0,12	0,27	0,02	0,02	0,02	0,02	0,02	-0,2	-0,1	0,01	0	-0,3	-0,4	-0,4	-0,1	-0,3	-0,3	-0,4	1	0,66	0,61	-0,1	0,55	-0,1	-0,3	-0,1	-0,3	-0,4	-0	-0,3	-0,3	-0,4	-0,3	-0,3	0,99	0,59	0	0,53		
25 - BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	-0,5	-0,5	-0,5	-0,5	-0,5	0,09	0,35	-0	-0	-0	-0	-0	-0,2	-0,1	0,07	-0,1	-0,6	-0,6	-0,5	-0,4	-0,5	-0,5	-0,6	0,66	1	0,88	-0,1	0,02	-0,3	-0,5	-0,1	-0,4	-0,5	-0,1	-0,4	-0,6	-0,6	-0,5	-0,4	0,65	0,42	0	0,03		
26 - MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA IE	-0,5	-0,5	-0,5	-0,5	-0,5	0,12	0,38	-0	-0	-0	-0	-0	-0,2	-0	0,11	-0,1	-0,5	-0,5	-0,5	-0,3	-0,4	-0,4	-0,5	0,61	0,88	1	-0,1	0,05	-0,3	-0,5	-0,1	-0,5	-0,5	-0,1	-0,4	-0,5	-0,5	-0,4	-0,4	0,62	0,34	0	0,06		
27 - RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO FI FINANCEIRO MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA	0,24	0,25	0,24	0,23	0,25	-0,1	-0,1	-0,1	-0,1	-0,1	-0,1	-0,1	0,05	-0,1	-0,1	0,06	0,18	0,15	0,17	0,18	0,19	0,21	0,2	-0,1	-0,1	-0,1	1	0,13	0,18	0,24	-0,1	0,24	0,23	-0,1	0,24	0,18	0,15	0,2	0,21	-0,1	0,1	0	0,13		
28 - FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LP	0,2	0,2	0,18	0,05	0,21	-0,1	-0	-0,1	-0,1	-0,1	-0,1	-0,1	0,16	-0,1	-0,1	0,17	0,31	0,29	0,19	0,43	0,25	0,27	0,29	0,55	0,02	0,05	0,13	1	0,33	0,19	-0,2	0,19	0,05	-0,2	0,17	0,31	0,29	0,3	0,27	0,57	0,55	0	0,98		
29 - RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	0,36	0,37	0,36	0,35	0,4	-0,1	-0,2	-0,1	-0,1	-0,1	-0,1	-0,1	0,21	-0	0,01	0,13	0,5	0,48	0,48	0,64	0,6	0,58	0,55	-0,1	-0,3	-0,3	0,18	0,33	1	0,36	-0,1	0,35	0,35	-0,1	0,31	0,5	0,49	0,63	0,61	-0,1	0	0	0,32		
30 - IMA-B 5	1	0,98	0,99	0,76	0,87	-0,2	-0,5	0,12	0,12	0,12	0,12	0,12	0,33	-0,1	-0,2	0,2	0,54	0,56	0,56	0,46	0,51	0,54	0,55	-0,3	-0,5	-0,5	0,24	0,19	0,36	1	0,03	0,98	0,74	-0	0,86	0,54	0,58	0,5	0,46	-0,3	-0	0	0,2		
31 - IPCA	0,02	0,01	0,03	0,05	-0,1	0,15	0,04	0,38	0,38	0,38	0,38	0,38	-0	0,06	-0,1	-0,2	-0,1	-0,1	-0,1	-0,2	-0,2	-0,1	-0,1	-0,1	-0,1	-0,1	-0,1	-0,1	-0,2	-0,1	0,03	1	0,03	0,05	0,44	-0	-0,1	-0,1	-0,2	-0,2	-0,1	-0,1	0	-0,2	
32 - IDKA 2	0,98	0,95	0,99	0,75	0,82	-0,2	-0,4	0,08	0,08	0,08	0,0																																		