

FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO

29/12/2023

Gráfico de Dispersão

Correlação

Ativo	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17	18	19	20	21	22
1 - BTG PACTUAL CREDITO CORPORATIVO I FIQ DE FI DE RF CREDITO PRIVADO	1,00	0,25	0,29	-0,05	0,25	0,32	-0,14	-0,08	-0,08	-0,14	-0,08	-0,08	0,15	-0,14	-0,08	-0,14	-0,09	-0,14	-0,13	-0,12	-0,14	-0,08
2 - PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	0,25	1,00	0,14	0,49	0,02	0,11	-0,11	-0,10	-0,10	-0,11	-0,10	-0,10	0,03	-0,11	-0,10	-0,11	-0,11	-0,11	-0,11	-0,11	-0,11	-0,10
3 - SANTANDER RF CRED PRIV CRESCIMENTO INSTITUCIONAL FI LP	0,29	0,14	1,00	0,09	0,09	0,43	-0,10	-0,07	-0,07	-0,10	-0,07	-0,07	0,01	-0,10	-0,07	-0,10	-0,08	-0,10	-0,10	-0,09	-0,10	-0,07
4 - ITAÚ HIGH GRADE RF CRÉDITO PRIVADO FIC FI	-0,05	0,49	0,09	1,00	0,08	0,10	-0,11	-0,09	-0,09	-0,11	-0,09	-0,09	0,02	-0,11	-0,09	-0,11	-0,10	-0,11	-0,11	-0,11	-0,11	-0,09
5 - SAFRA EXTRA BANCOS FIC DE FI RF CREDITO PRIVADO	0,25	0,02	0,09	0,08	1,00	0,24	-0,06	-0,08	-0,08	-0,06	-0,08	-0,08	0,24	-0,06	-0,08	-0,06	-0,07	-0,06	-0,06	-0,07	-0,06	-0,08
6 - BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV	0,32	0,11	0,43	0,10	0,24	1,00	-0,13	-0,13	-0,13	-0,13	-0,13	-0,13	0,07	-0,13	-0,13	-0,13	-0,13	-0,13	-0,13	-0,13	-0,13	-0,13
7 - NTN-B 150527 (6,310000%)	-0,14	-0,11	-0,10	-0,11	-0,06	-0,13	1,00	0,82	0,83	1,00	0,82	0,83	0,06	1,00	0,82	1,00	0,86	1,00	0,99	0,96	1,00	0,82
8 - NTN-B 150840 (6,499000%)	-0,08	-0,10	-0,07	-0,09	-0,08	-0,13	0,82	1,00	1,00	0,82	1,00	1,00	0,05	0,82	1,00	0,82	1,00	0,82	0,90	0,94	0,82	1,00
9 - NTN-B 150840 (6,350000%)	-0,08	-0,10	-0,07	-0,09	-0,08	-0,13	0,83	1,00	1,00	0,82	1,00	1,00	0,05	0,83	1,00	0,83	1,00	0,83	0,90	0,95	0,82	1,00
10 - NTN-B 150824 (6,990200%)	-0,14	-0,11	-0,10	-0,11	-0,06	-0,13	1,00	0,82	0,82	1,00	0,82	0,83	0,06	1,00	0,82	1,00	0,86	1,00	0,99	0,96	1,00	0,82
11 - NTN-B 150840 (6,392000%)	-0,08	-0,10	-0,07	-0,09	-0,08	-0,13	0,82	1,00	1,00	0,82	1,00	1,00	0,05	0,82	1,00	0,82	1,00	0,82	0,90	0,94	0,82	1,00

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