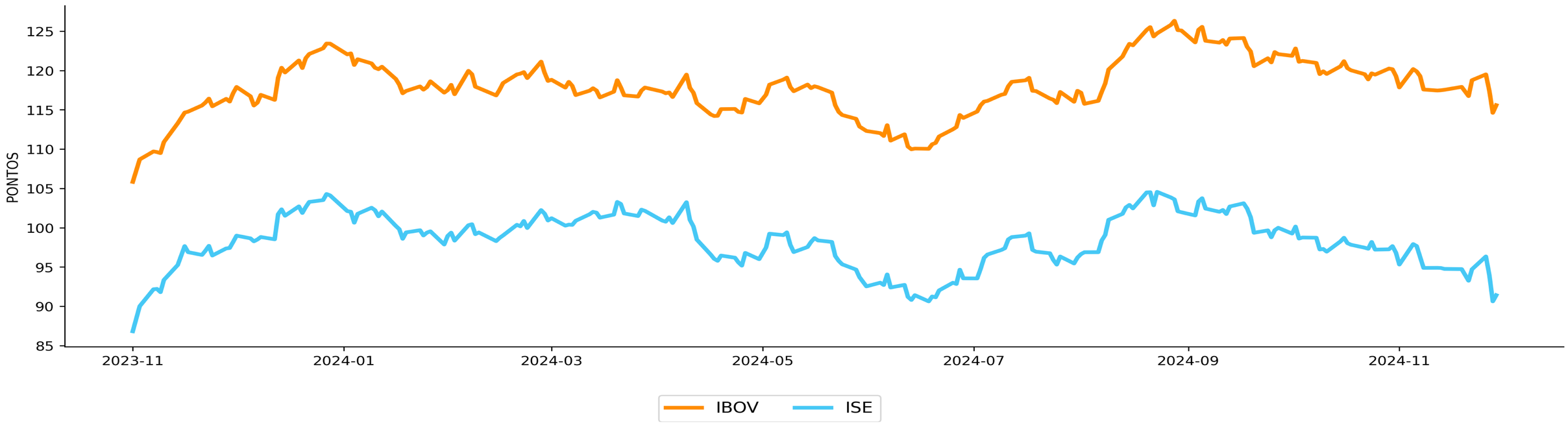
Boletim Mensal de ISE

November/2024

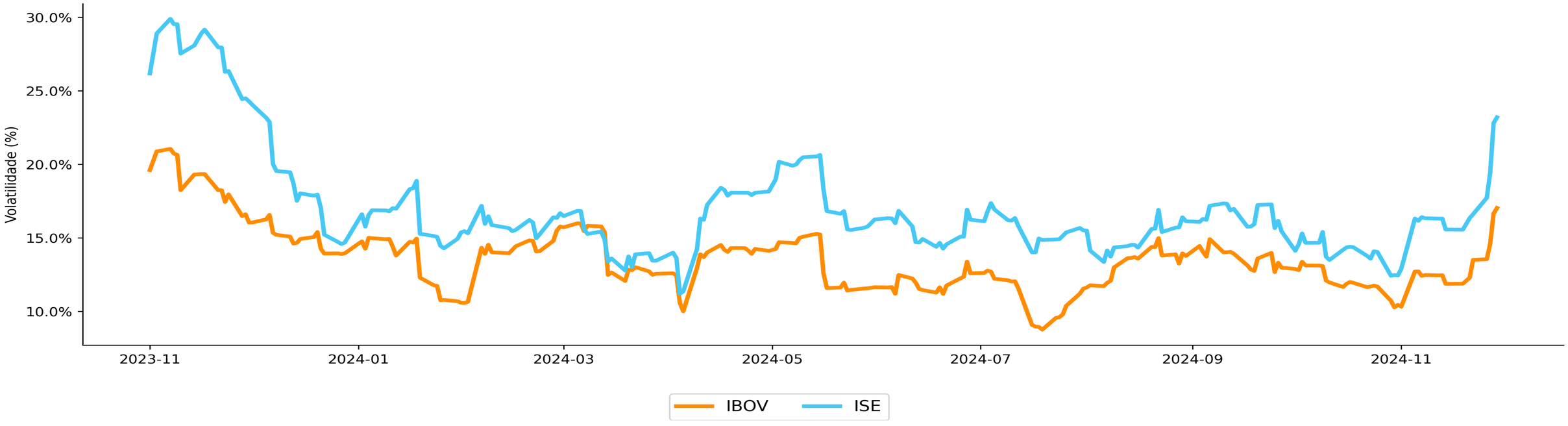
Comparativo ISE e Outros Indicadores



Indice	Variação MoM (%)	Variação YTD (%)	Variação 12M (%)	Variação Total (%)*
IGPTW B3	-5.35	-16.46	-12.33	-18.37
IBOV	-3.12	-5.30	-1.31	15.59
IBRX 50	-2.62	-3.38	0.80	19.36
IBRX 100	-2.91	-4.55	-0.40	17.19
ICO2	-3.77	-5.15	-1.07	-7.32
IGC TRADE	-3.10	-4.58	-0.39	18.27
IGC - NM	-4.39	-8.33	-4.98	2.08
ISE	-5.60	-10.48	-6.90	-8.59

*Mês base para cálculo da Variação Total fixado em Novembro de 2019.

Volatilidade ISE e Outros Indicadores

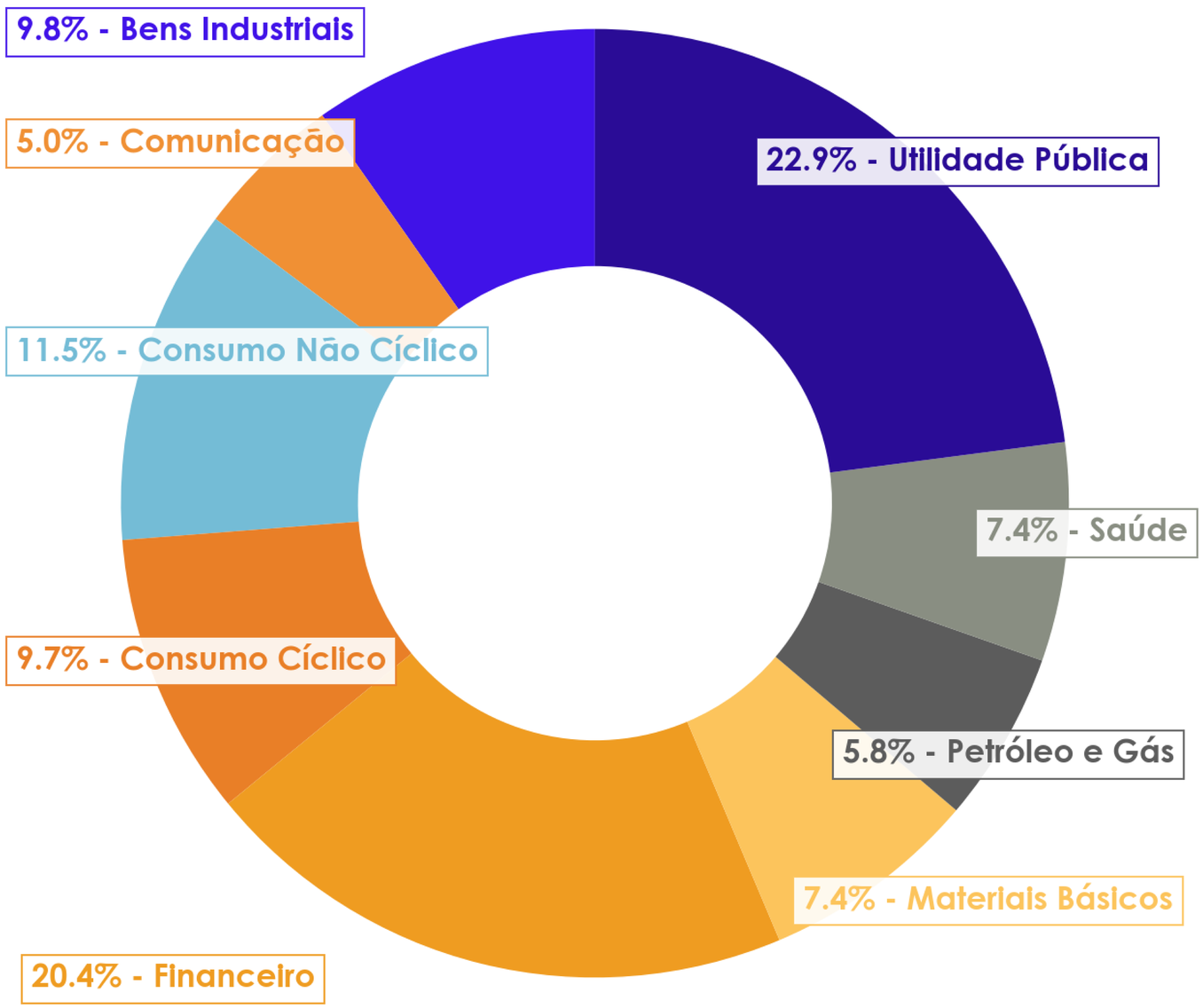


Variação Índice	Variação - Mês (%)*	Variação - Ano (%)**
IGPTW B3	92.04	6.80
IBOV	63.17	6.19
IBRX 50	65.06	8.96
IBRX 100	66.10	6.36
ICO2	76.64	0.40
IGC TRADE	71.39	6.31
IGC - NM	52.42	-2.71
ISE	86.55	-4.48

*Informação de Volatilidade Mensal apresentada na forma anualizada;
**Informação de Volatilidade Ano considera o comparativo entre a volatilidade do mês analisado com o mesmo mês no ano anterior.

Representatividade - Setores Econômicos

Composição do ISE em Setores Econômicos

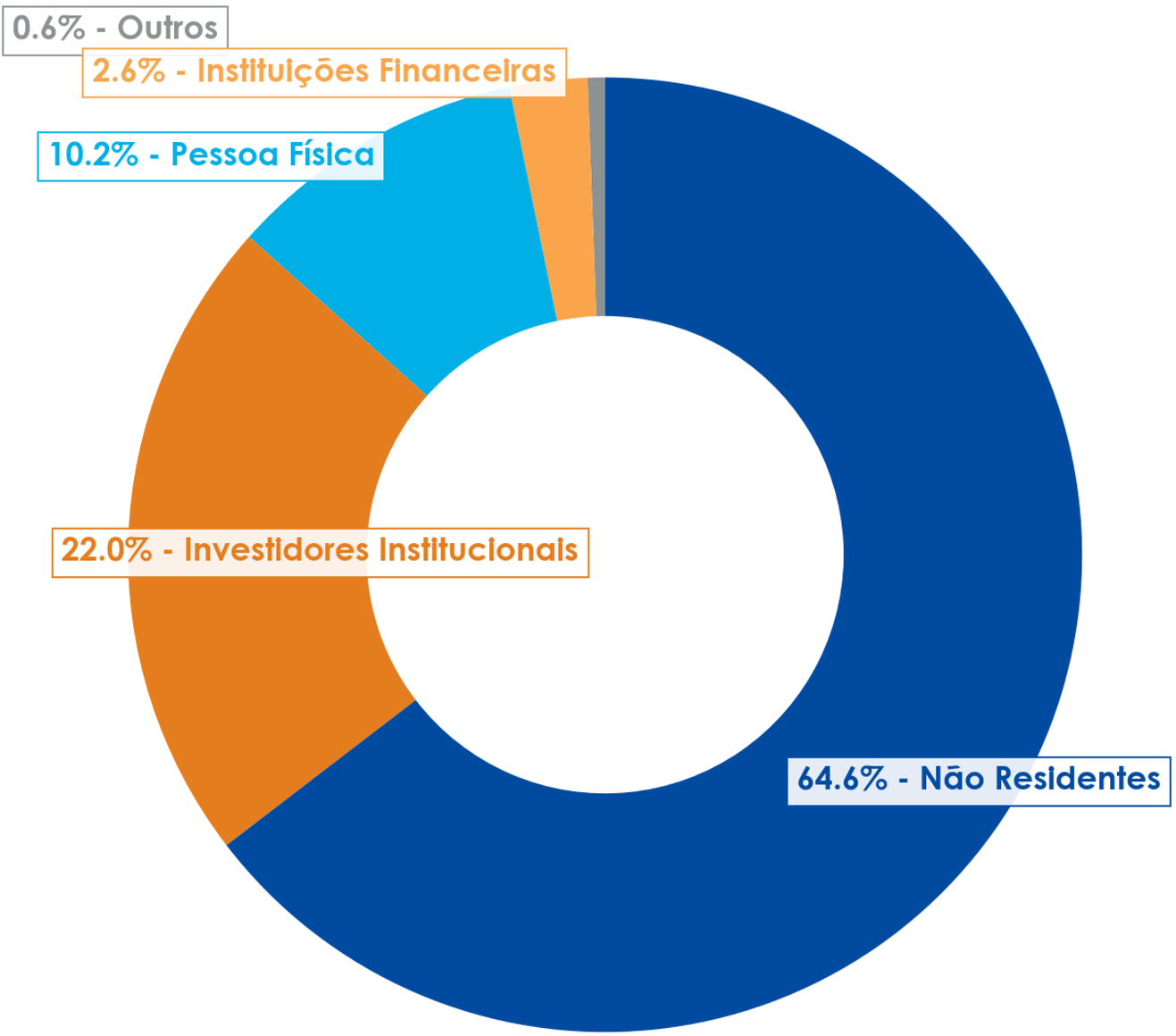


Composição ISE - TOP 15 Ativos

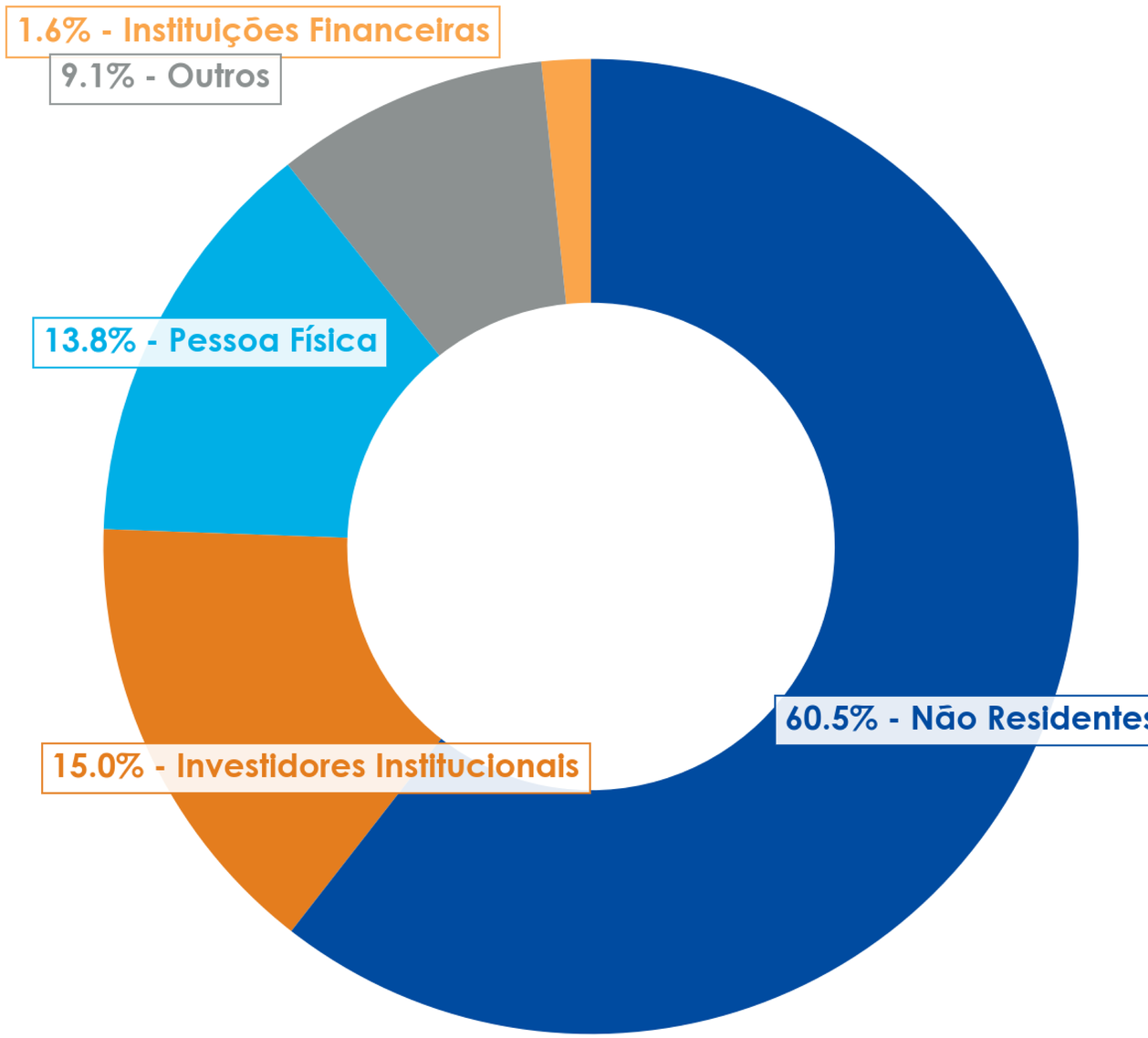
Ticker	Setor Econômico	% Mercado
SUZB3	Materiais Básicos	2.92
VIVT3	Comunicação	2.63
KLBN11	Materiais Básicos	2.63
NTCO3	Consumo Não Cíclico	2.52
CMIG4	Utilidade Pública	2.46
CPLE6	Utilidade Pública	2.43
TIMS3	Comunicação	2.38
EGIE3	Utilidade Pública	2.33
ISAE4	Utilidade Pública	2.33
WEGE3	Bens Industriais	2.33
LREN3	Consumo Cíclico	2.31
ENEV3	Utilidade Pública	2.28
RADL3	Saúde	2.25
BRFS3	Consumo Não Cíclico	2.25
BBAS3	Financeiro	2.23

Participação por Tipo Investidor*

Participação no volume negociado (R$) – November/2024



Participação na posição em custódia (R$) – November/2024



*Para análise de dados de informações por Tipo de Investidor são considerados apenas os ativos presentes na carteira do ISE.

Composição de Carteira

Código Ativo	Setor Econômico	Lucratividade (Mês) (%)*	Lucratividade (Ano) (%)**	Preço de Fechamento (R$)	Volatilidade Ativo (Mês) (%)***	Volatilidade Ativo (Ano) (%)****	Participação Ativo
SUZB3	Materiais Básicos	4.40	18.74	62.40	27.56	103.45	2.92
VIVT3	Comunicação	-5.93	-1.23	49.52	21.55	96.90	2.63
KLBN11	Materiais Básicos	8.29	15.04	22.21	20.93	93.48	2.63
NTCO3	Consumo Não Cíclico	1.24	-12.32	13.88	36.66	69.52	2.52
CMIG4	Utilidade Pública	4.66	63.70	11.90	24.84	93.38	2.46
CPLE6	Utilidade Pública	-1.02	4.88	9.71	19.93	81.71	2.43
TIMS3	Comunicação	-4.46	-2.10	15.84	24.29	111.94	2.38
EGIE3	Utilidade Pública	-8.37	-7.51	38.00	17.51	100.86	2.33
ISAE4	Utilidade Pública	-0.54	9.26	24.16	22.57	-	2.33
WEGE3	Bens Industriais	-0.31	60.68	53.94	24.90	97.08	2.33
LREN3	Consumo Cíclico	-18.90	-4.13	15.06	41.51	83.81	2.31
ENEV3	Utilidade Pública	-11.70	-8.98	11.55	23.15	71.67	2.28
RADL3	Saúde	-1.23	-13.19	24.04	24.21	103.24	2.25
BRFS3	Consumo Não Cíclico	-3.20	73.19	24.81	38.86	61.56	2.25
BBAS3	Financeiro	-4.13	0.30	24.77	16.92	65.48	2.23
BPAC11	Financeiro	-6.89	-12.79	30.28	0.00	-	2.21

*Lucratividade Mensal calculada a partir da comparação do preço de fechamento no último dia do mês e o último dia do mês anterior;
**Lucratividade Anual calculada a partir da comparação do preço de fechamento no último dia do mês e o último dia do mesmo mês no ano anterior.
***Informação de Volatilidade Mensal apresentada na forma anualizada;
****Informação de Volatilidade Ano considera o comparativo entre a volatilidade do mês analisado com o mesmo mês no ano anterior;

Composição de Carteira

Código Ativo	Setor Econômico	Lucratividade (Mês) (%)*	Lucratividade (Ano) (%)**	Preço de Fechamento (R$)	Volatilidade Ativo (Mês) (%)***	Volatilidade Ativo (Ano) (%)****	Participação Ativo
ITUB4	Financeiro	-6.86	10.55	32.60	17.89	73.53	2.20
ITSA4	Financeiro	-8.11	6.84	9.75	17.81	80.77	2.19
BBDC4	Financeiro	-11.99	-14.11	12.63	26.74	87.67	2.18
STBP3	Bens Industriais	1.50	85.41	12.82	36.41	99.62	2.14
RAIL3	Bens Industriais	-2.26	-14.67	19.45	24.52	86.31	2.14
ABEV3	Consumo Não Cíclico	0.71	-2.15	12.73	18.60	90.60	2.12
CCRO3	Bens Industriais	-8.83	-15.76	11.03	22.67	82.38	2.10
SANB11	Financeiro	-8.35	-14.93	24.93	20.69	80.29	2.09
RDOR3	Saúde	-7.87	3.99	27.05	30.73	68.89	2.09
ELET3	Utilidade Pública	-9.48	-14.97	34.37	23.56	76.69	2.06
ALOS3	Financeiro	-10.59	-17.60	19.69	22.48	73.15	1.84
VBBR3	Petróleo e Gás	-7.53	-4.67	20.63	26.61	74.77	1.83
B3SA3	Financeiro	-12.81	-28.02	9.26	28.08	74.19	1.83
PSSA3	Financeiro	-0.81	42.43	37.84	20.96	87.52	1.78
CSAN3	Petróleo e Gás	-13.79	-40.57	10.19	30.78	98.09	1.77
AMBP3	Utilidade Pública	24.51	979.02	160.99	97.39	194.12	1.70

*Lucratividade Mensal calculada a partir da comparação do preço de fechamento no último dia do mês e o último dia do mês anterior;
**Lucratividade Anual calculada a partir da comparação do preço de fechamento no último dia do mês e o último dia do mesmo mês no ano anterior.
***Informação de Volatilidade Mensal apresentada na forma anualizada;
****Informação de Volatilidade Ano considera o comparativo entre a volatilidade do mês analisado com o mesmo mês no ano anterior;

Composição de Carteira

Código Ativo	Setor Econômico	Lucratividade (Mês) (%)*	Lucratividade (Ano) (%)**	Preço de Fechamento (R$)	Volatilidade Ativo (Mês) (%)***	Volatilidade Ativo (Ano) (%)****	Participação Ativo
CPFE3	Utilidade Pública	-0.46	-4.42	32.62	17.07	69.96	1.63
FLRY3	Saúde	-11.07	-19.65	13.18	21.22	70.57	1.60
ASAI3	Consumo Não Cíclico	-11.88	-48.96	6.60	40.88	93.12	1.58
SAPR11	Utilidade Pública	12.04	21.10	30.25	23.76	96.62	1.50
UGPA3	Petróleo e Gás	-14.12	-27.19	17.94	28.85	90.81	1.44
HYPE3	Saúde	-11.67	-39.98	19.52	33.88	118.75	1.41
AURE3	Utilidade Pública	-3.80	-22.99	9.86	17.04	93.32	1.29
CYRE3	Consumo Cíclico	-15.36	-11.98	18.40	34.20	86.39	1.27
CSMG3	Utilidade Pública	10.11	61.07	25.38	26.79	88.77	1.23
AZZA3	Consumo Cíclico	-11.03	-37.54	36.69	36.82	-	1.18
IGTI11	Financeiro	-9.41	-14.42	19.15	23.70	76.85	1.06
NEOE3	Utilidade Pública	1.57	4.43	19.40	20.96	79.42	0.99
CRFB3	Consumo Não Cíclico	-14.55	-43.56	6.40	42.17	89.97	0.93
SLCE3	Consumo Não Cíclico	2.35	-3.11	17.41	22.30	86.53	0.89
MGLU3	Consumo Cíclico	-4.55	-55.02	9.03	62.27	80.54	0.83
USIM5	Materiais Básicos	-7.11	-19.19	6.14	44.20	136.46	0.81

*Lucratividade Mensal calculada a partir da comparação do preço de fechamento no último dia do mês e o último dia do mês anterior;
**Lucratividade Anual calculada a partir da comparação do preço de fechamento no último dia do mês e o último dia do mesmo mês no ano anterior.
***Informação de Volatilidade Mensal apresentada na forma anualizada;
****Informação de Volatilidade Ano considera o comparativo entre a volatilidade do mês analisado com o mesmo mês no ano anterior;

Composição de Carteira

Código Ativo	Setor Econômico	Lucratividade (Mês) (%)*	Lucratividade (Ano) (%)**	Preço de Fechamento (R$)	Volatilidade Ativo (Mês) (%)***	Volatilidade Ativo (Ano) (%)****	Participação Ativo
RAIZ4	Petróleo e Gás	-5.71	-24.67	2.64	32.31	74.33	0.79
VAMO3	Consumo Cíclico	-7.95	-35.21	5.79	46.31	94.74	0.73
YDUQ3	Consumo Cíclico	-12.82	-53.13	9.25	48.43	76.47	0.71
SRNA3	Utilidade Pública	-23.98	-33.44	6.31	37.09	-	0.69
COGN3	Consumo Cíclico	-8.51	-60.06	1.29	53.96	114.08	0.63
BPAN4	Financeiro	-15.88	-7.83	7.15	31.30	76.16	0.56
DXCO3	Materiais Básicos	-12.44	3.38	7.25	39.05	85.49	0.55
MRVE3	Consumo Cíclico	-23.70	-45.40	5.28	48.09	88.43	0.52
ECOR3	Bens Industriais	-22.86	-34.69	5.50	43.53	96.50	0.46
AZUL4	Bens Industriais	-13.20	-70.81	4.93	73.08	91.74	0.42
MYPK3	Consumo Cíclico	15.11	3.52	11.73	35.24	100.43	0.39
MDIA3	Consumo Não Cíclico	-11.20	-35.88	22.21	26.60	63.70	0.38
BEEF3	Consumo Não Cíclico	0.86	-19.42	5.85	34.32	78.95	0.37
GRND3	Consumo Cíclico	0.14	-15.70	5.18	22.82	72.58	0.36
CBAV3	Materiais Básicos	9.11	53.38	6.35	54.07	103.09	0.33
CEAB3	Consumo Cíclico	-18.88	30.01	10.57	60.88	78.93	0.27

*Lucratividade Mensal calculada a partir da comparação do preço de fechamento no último dia do mês e o último dia do mês anterior;
**Lucratividade Anual calculada a partir da comparação do preço de fechamento no último dia do mês e o último dia do mesmo mês no ano anterior.
***Informação de Volatilidade Mensal apresentada na forma anualizada;
****Informação de Volatilidade Ano considera o comparativo entre a volatilidade do mês analisado com o mesmo mês no ano anterior;

Composição de Carteira

Código Ativo	Setor Econômico	Lucratividade (Mês) (%)*	Lucratividade (Ano) (%)**	Preço de Fechamento (R$)	Volatilidade Ativo (Mês) (%)***	Volatilidade Ativo (Ano) (%)****	Participação Ativo
SIMH3	Financeiro	-13.64	-45.52	4.62	51.73	105.98	0.27
PCAR3	Consumo Não Cíclico	-12.00	-21.19	2.64	66.14	119.49	0.26
RANI3	Materiais Básicos	-5.81	-26.82	7.09	30.40	96.72	0.20
MOVI3	Consumo Cíclico	-12.50	-52.83	5.25	54.82	93.29	0.17
CAML3	Consumo Não Cíclico	-8.48	-1.57	7.16	34.05	76.67	0.17
GUAR3	Consumo Cíclico	-17.90	16.00	6.97	58.45	81.93	0.14
JSLG3	Bens Industriais	-14.72	-30.03	6.78	44.91	105.55	0.11
BHIA3	Consumo Cíclico	-9.71	-72.44	3.72	81.75	109.01	0.09
DASA3	Saúde	-14.72	-75.41	2.26	66.69	94.09	0.08
MTRE3	Consumo Cíclico	-3.66	-20.31	3.52	49.56	90.44	0.05
AERI3	Bens Industriais	-14.49	-69.48	5.31	73.16	97.38	0.05
GFSA3	Consumo Cíclico	-3.90	-73.47	1.48	97.41	75.61	0.03

*Lucratividade Mensal calculada a partir da comparação do preço de fechamento no último dia do mês e o último dia do mês anterior;
**Lucratividade Anual calculada a partir da comparação do preço de fechamento no último dia do mês e o último dia do mesmo mês no ano anterior.
***Informação de Volatilidade Mensal apresentada na forma anualizada;
****Informação de Volatilidade Ano considera o comparativo entre a volatilidade do mês analisado com o mesmo mês no ano anterior;

BRASIL
BOLSA
BALCÃO