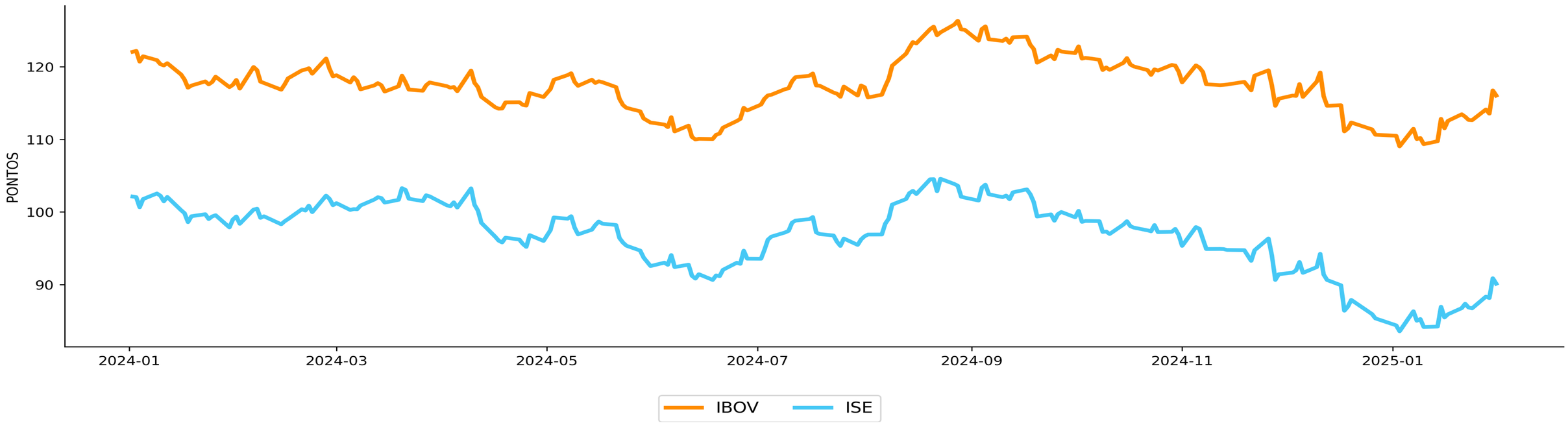
Boletim Mensal de ISE

January/2025

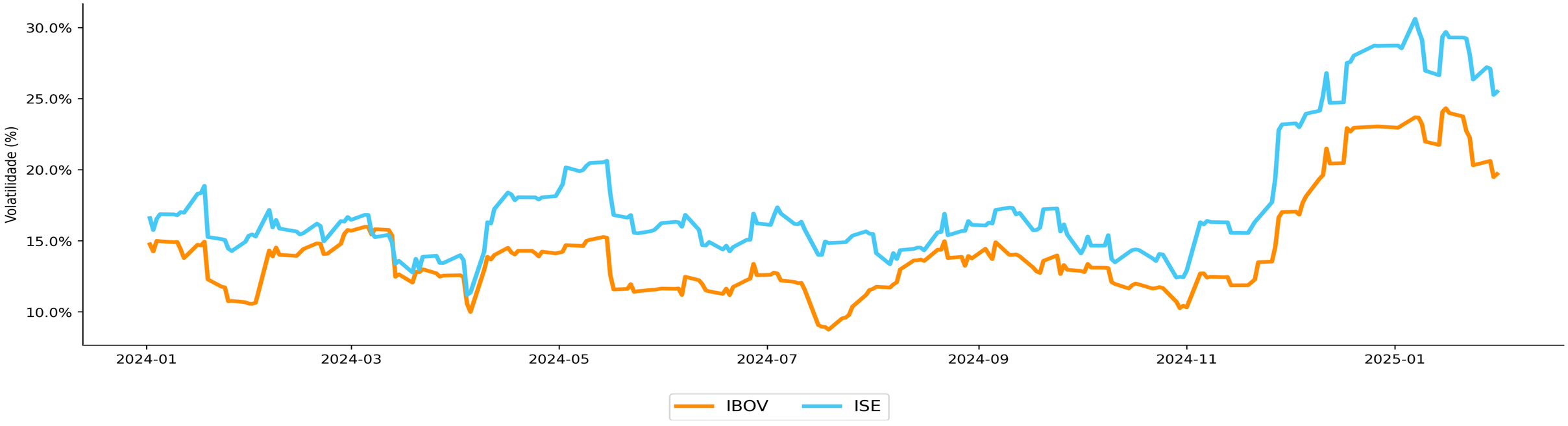
Comparativo ISE e Outros Indicadores



Indice	Variação MoM (%)	Variação YTD (%)	Variação 12M (%)	Variação Total (%)*
IGPTW B3	7.24	0.00	-13.99	-18.51
IBOV	4.88	0.00	-1.27	16.02
IBRX 50	4.84	0.00	0.47	20.09
IBRX 100	4.93	0.00	-0.80	17.56
ICO2	6.71	0.00	-0.14	-5.83
IGC TRADE	5.22	0.00	-0.82	18.84
IGC - NM	4.15	0.00	-4.31	1.10
ISE	5.60	0.00	-8.95	-9.91

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

Volatilidade ISE e Outros Indicadores

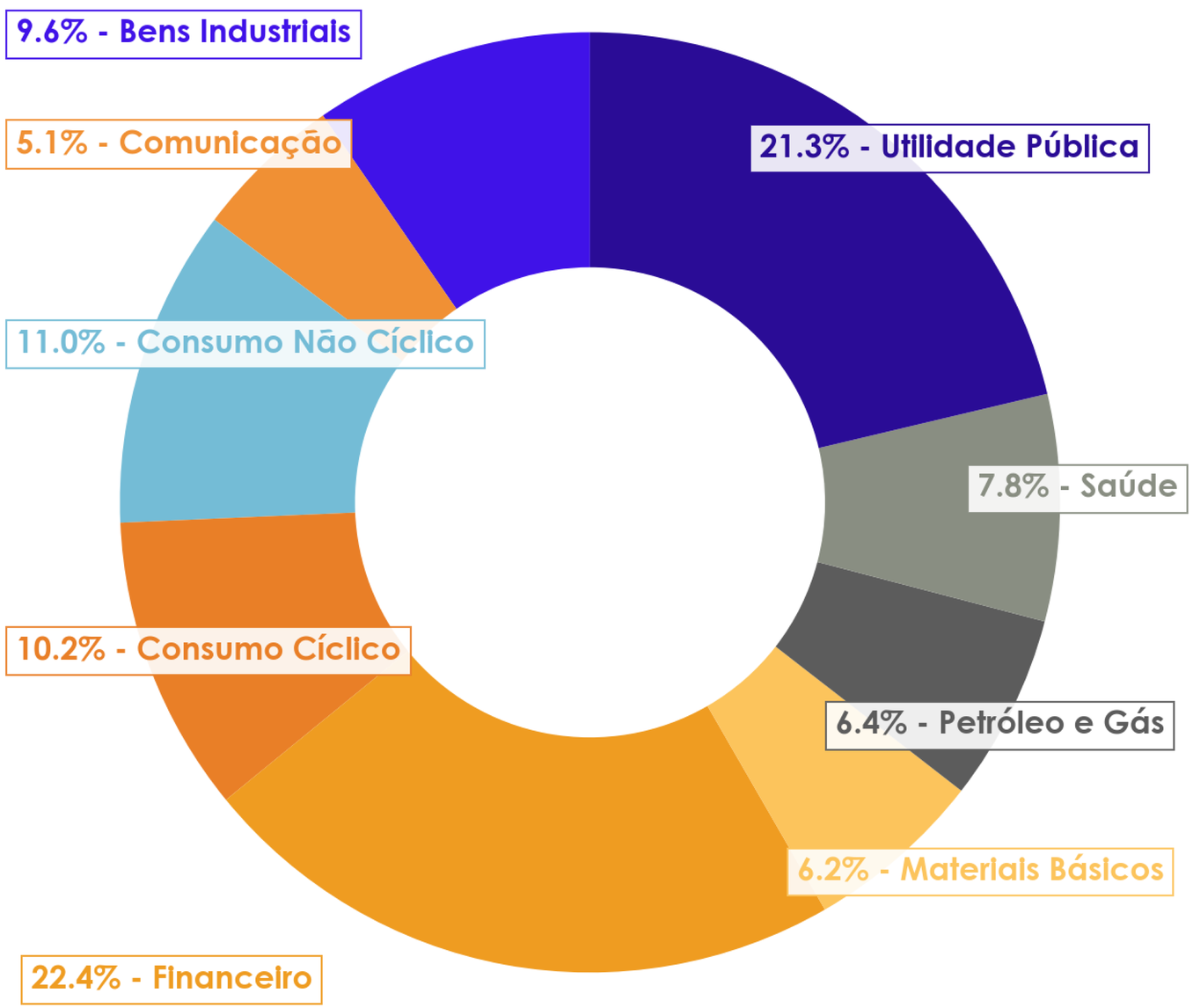


Variação Índice	Variação - Mês (%)*	Variação - Ano (%)**
IGPTW B3	-8.51	56.57
IBOV	-14.53	86.20
IBRX 50	-15.49	83.52
IBRX 100	-15.44	84.66
ICO2	1.10	108.49
IGC TRADE	-15.69	77.86
IGC - NM	-16.28	63.76
ISE	-11.22	65.93

*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

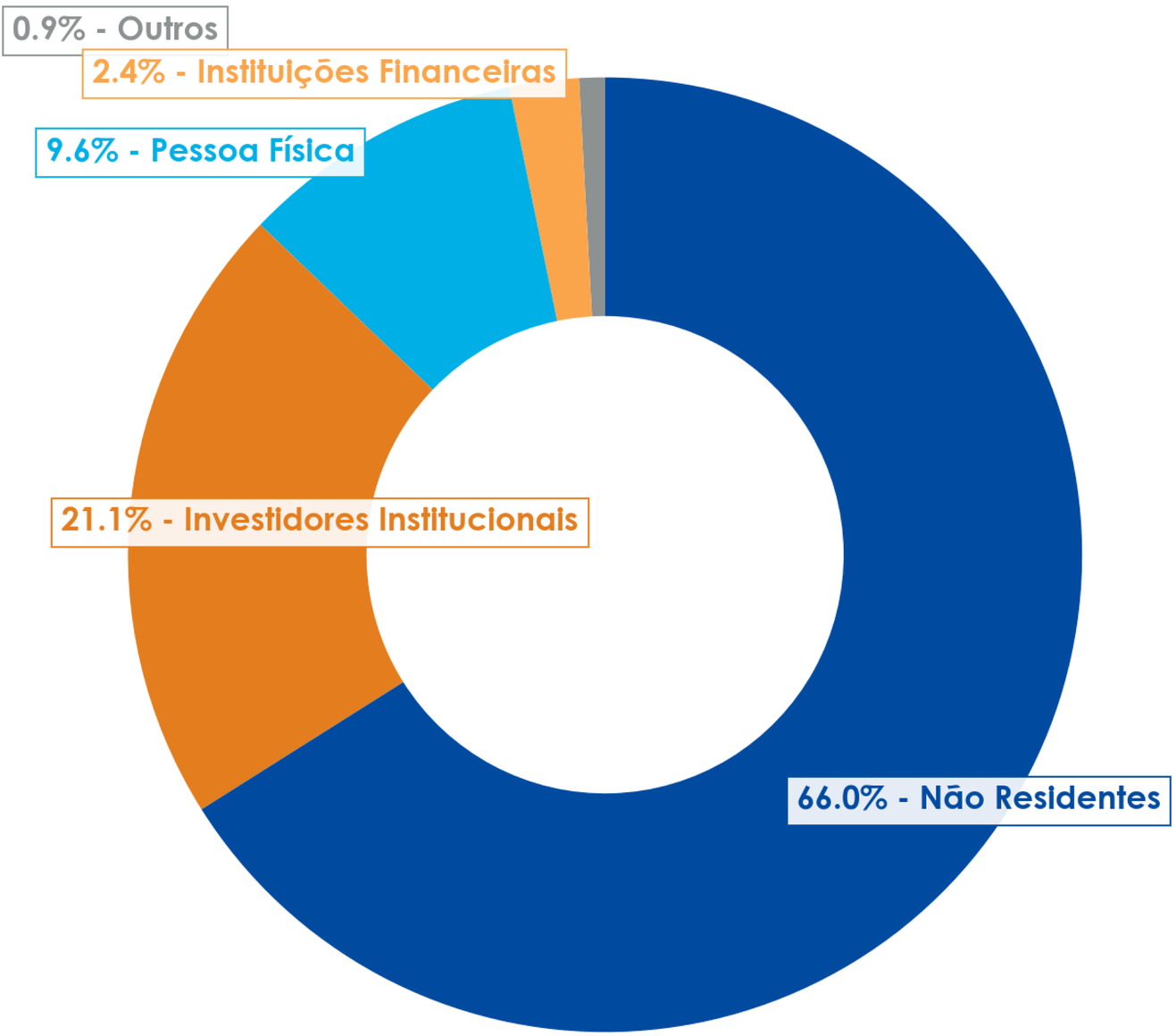


Composição ISE - TOP 15 Ativos

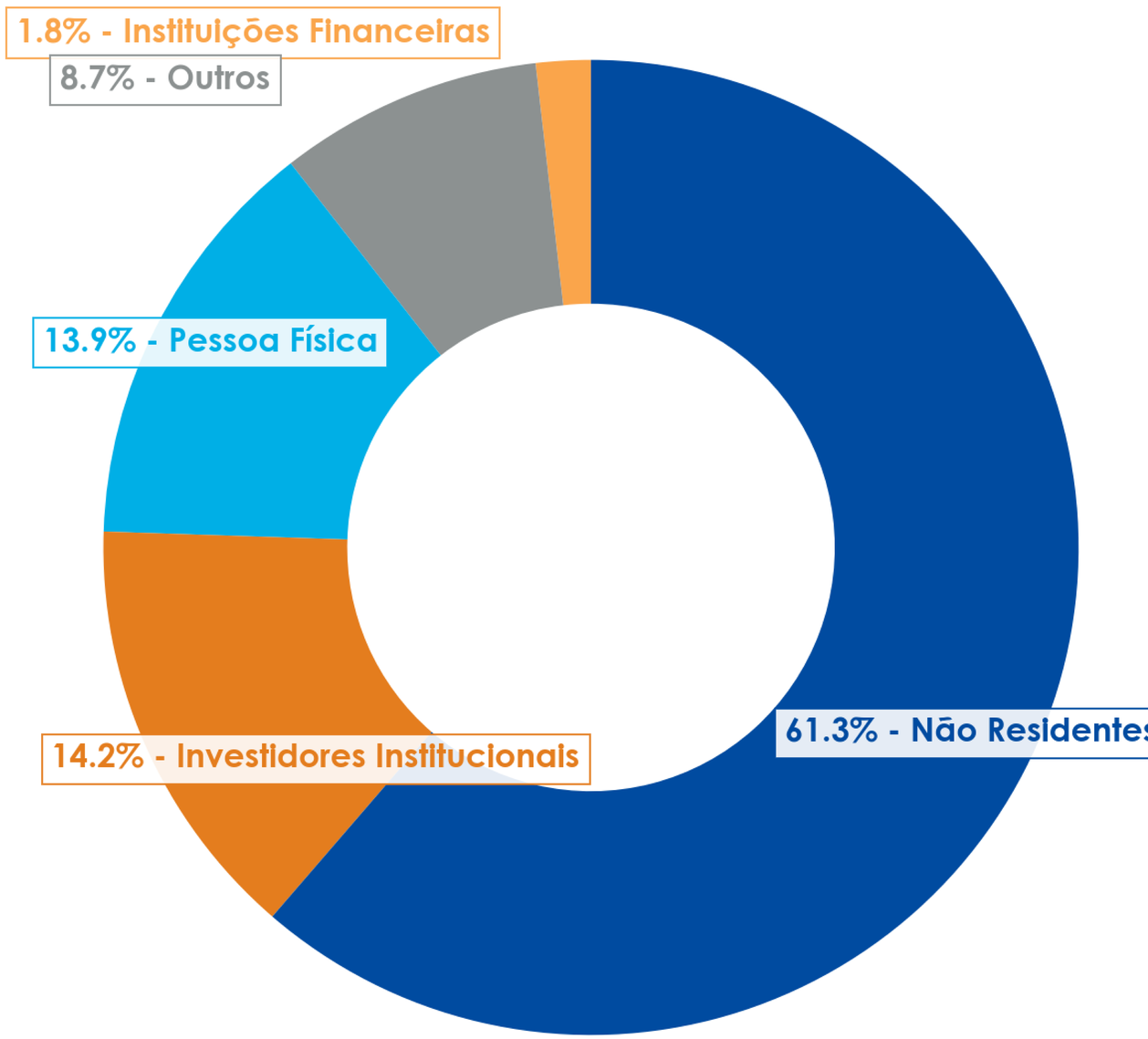
Ticker	Setor Econômico	% Mercado
LREN3	Consumo Cíclico	2.72
BPAC11	Financeiro	2.59
VIVT3	Comunicação	2.59
TIMS3	Comunicação	2.52
CCRO3	Bens Industriais	2.49
BBAS3	Financeiro	2.48
BBDC4	Financeiro	2.43
EGIE3	Utilidade Pública	2.42
CPLE6	Utilidade Pública	2.39
SANB11	Financeiro	2.37
ITUB4	Financeiro	2.36
RDOR3	Saúde	2.35
B3SA3	Financeiro	2.32
ASAI3	Consumo Não Cíclico	2.31
ELET3	Utilidade Pública	2.30

Participação por Tipo Investidor*

Participação no volume negociado (R$) – January/2025



Participação na posição em custódia (R$) – January/2025



*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
LREN3	Consumo Cíclico	12.62	-2.16	13.65	43.26	92.04	2.72
BPAC11	Financeiro	20.41	-6.92	32.57	0.00	-	2.59
VIVT3	Comunicação	10.90	6.89	51.87	23.96	120.83	2.59
TIMS3	Comunicação	7.80	-3.79	15.61	26.10	124.17	2.52
CCRO3	Bens Industriais	10.42	-11.49	11.23	24.92	107.55	2.49
BBAS3	Financeiro	14.52	7.83	27.68	17.59	77.59	2.48
BBDC4	Financeiro	7.49	-14.07	12.09	28.14	100.79	2.43
EGIE3	Utilidade Pública	3.66	-3.56	36.80	18.10	107.35	2.42
CPLE6	Utilidade Pública	6.01	-0.02	9.70	21.44	96.45	2.39
SANB11	Financeiro	10.74	-3.90	25.96	22.29	95.26	2.37
ITUB4	Financeiro	10.09	10.68	33.81	19.60	87.19	2.36
RDOR3	Saúde	9.95	5.41	27.95	30.44	76.31	2.35
B3SA3	Financeiro	9.11	-11.68	11.19	28.88	84.42	2.32
ASAI3	Consumo Não Cíclico	21.70	-49.84	6.74	43.91	96.21	2.31
ELET3	Utilidade Pública	5.74	-8.35	36.09	23.93	80.93	2.30
ITSA4	Financeiro	7.93	6.72	9.53	19.41	93.00	2.29

*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
SUZB3	Materiais Básicos	0.96	24.77	62.37	27.59	110.63	2.27
ENEV3	Utilidade Pública	12.06	-7.52	11.80	27.43	91.34	2.23
KLBN11	Materiais Básicos	-3.28	23.47	22.44	18.89	83.22	2.18
RADL3	Saúde	-4.14	-15.52	21.09	27.37	119.36	2.18
NTCO3	Consumo Não Cíclico	-1.10	-17.84	12.62	38.20	81.59	2.16
RAIL3	Bens Industriais	3.14	-19.84	18.40	25.40	96.03	2.16
WEGE3	Bens Industriais	4.30	73.23	55.04	26.76	109.18	2.14
ISAE4	Utilidade Pública	7.02	-3.84	23.80	21.02	-	2.14
CSAN3	Petróleo e Gás	-5.15	-56.14	7.74	33.70	114.35	2.08
CMIG4	Utilidade Pública	-1.35	39.77	10.96	25.92	107.37	2.06
ALOS3	Financeiro	5.44	-16.20	19.00	23.35	82.95	1.97
VBBR3	Petróleo e Gás	-5.49	-23.69	16.86	27.82	80.29	1.95
PSSA3	Financeiro	10.69	56.93	39.99	22.59	102.64	1.88
STBP3	Bens Industriais	0.38	58.41	13.18	34.86	107.16	1.83
UGPA3	Petróleo e Gás	4.16	-39.83	16.54	31.88	110.39	1.79
ABEV3	Consumo Não Cíclico	-5.45	-10.46	11.10	21.07	108.66	1.77

*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
HYPE3	Saúde	1.05	-39.70	18.28	33.82	117.23	1.76
BRFS3	Consumo Não Cíclico	-13.68	61.29	21.89	38.74	65.02	1.76
CPFE3	Utilidade Pública	8.83	2.93	34.38	17.68	79.57	1.67
CYRE3	Consumo Cíclico	20.53	-5.96	20.43	34.79	92.26	1.44
FLRY3	Saúde	-1.91	-23.67	11.84	23.29	88.12	1.41
SAPR11	Utilidade Pública	-4.96	-3.31	25.65	24.88	104.19	1.35
AMBP3	Utilidade Pública	1.18	857.35	131.54	115.66	238.92	1.31
AZZA3	Consumo Cíclico	15.45	-43.94	34.15	36.20	-	1.23
CSMG3	Utilidade Pública	7.49	19.01	22.38	27.91	95.39	1.09
IGTI11	Financeiro	6.72	-20.36	18.43	25.99	97.34	1.01
NEOE3	Utilidade Pública	-0.85	-4.87	18.75	20.76	79.78	0.95
SLCE3	Consumo Não Cíclico	-0.80	-4.98	17.36	22.39	89.63	0.90
CRFB3	Consumo Não Cíclico	14.00	-39.53	6.19	48.50	103.41	0.86
USIM5	Materiais Básicos	3.57	-37.98	5.51	45.78	150.94	0.75
YDUQ3	Consumo Cíclico	19.88	-45.88	10.25	53.29	84.28	0.74
SRNA3	Utilidade Pública	18.55	-32.44	6.52	38.41	88.00	0.70

*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
AURE3	Utilidade Pública	-7.53	-36.49	8.11	20.18	132.07	0.68
MGLU3	Consumo Cíclico	14.77	-64.25	7.46	62.59	83.33	0.68
COGN3	Consumo Cíclico	29.36	-51.71	1.41	57.69	129.23	0.67
VAMO3	Consumo Cíclico	1.89	-35.66	4.84	51.73	109.04	0.61
RAIZ4	Petróleo e Gás	-12.04	-49.99	1.90	34.62	83.62	0.61
MRVE3	Consumo Cíclico	6.21	-28.43	5.64	47.29	84.86	0.56
BPAN4	Financeiro	8.83	-8.98	6.90	31.76	80.92	0.52
DXCO3	Materiais Básicos	-1.01	-22.53	5.90	38.57	85.83	0.47
MYPK3	Consumo Cíclico	20.57	15.49	13.60	37.59	114.39	0.46
ECOR3	Bens Industriais	22.64	-41.11	5.20	47.99	116.09	0.46
MDIA3	Consumo Não Cíclico	15.11	-39.21	23.08	33.10	81.93	0.41
GRND3	Consumo Cíclico	17.21	-9.38	5.72	25.04	90.27	0.39
AZUL4	Bens Industriais	29.94	-65.67	4.60	75.64	95.38	0.39
BEEF3	Consumo Não Cíclico	-4.91	-29.34	4.84	40.94	97.08	0.33
PCAR3	Consumo Não Cíclico	5.88	-30.95	2.70	63.75	101.29	0.33
CBAV3	Materiais Básicos	15.99	35.32	5.44	54.47	101.00	0.29

*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
CEAB3	Consumo Cíclico	27.06	40.11	9.79	61.44	86.67	0.26
SIMH3	Financeiro	2.85	-53.78	3.61	55.05	118.34	0.21
RANI3	Materiais Básicos	7.04	-20.47	7.30	29.02	91.17	0.20
GUAR3	Consumo Cíclico	5.17	25.61	6.51	60.63	87.76	0.14
MOVI3	Consumo Cíclico	11.58	-55.51	3.95	56.78	101.23	0.13
CAML3	Consumo Não Cíclico	-18.63	-44.59	4.76	35.79	94.61	0.12
JSLG3	Bens Industriais	3.70	-44.69	5.61	49.20	118.67	0.09
DASA3	Saúde	-2.11	-76.89	1.86	68.95	97.51	0.09
BHIA3	Consumo Cíclico	22.15	-55.26	3.53	80.93	110.77	0.09
AERI3	Bens Industriais	10.16	-59.68	6.29	111.74	173.08	0.06
MTRE3	Consumo Cíclico	14.46	-26.13	3.27	47.84	87.94	0.05
GFSA3	Consumo Cíclico	16.10	-88.58	1.37	92.22	96.20	0.04

*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