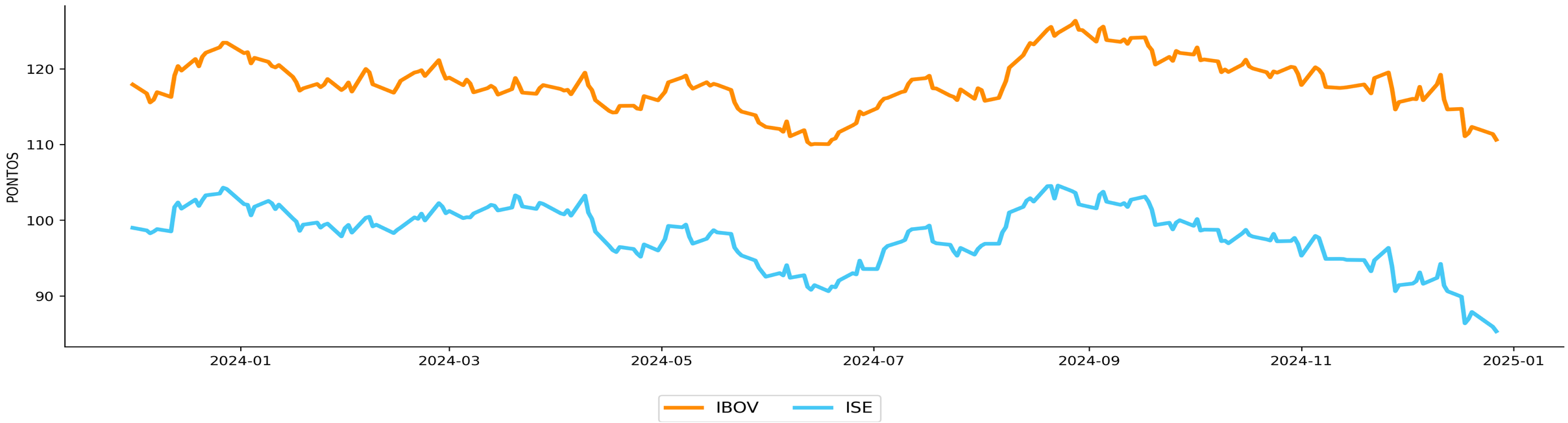
Boletim Mensal de ISE

December/2024

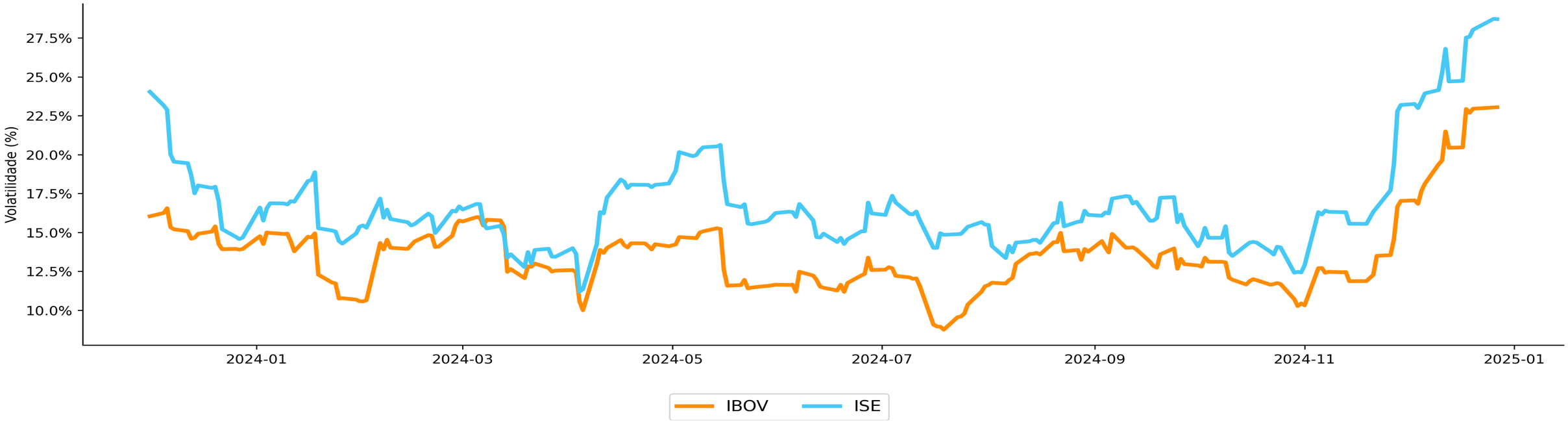
Comparativo ISE e Outros Indicadores



Indice	Variação MoM (%)	Variação YTD (%)	Variação 12M (%)	Variação Total (%)*
IGPTW B3	-6.92	-19.80	-24.50	-24.01
IBOV	-4.30	-5.86	-10.37	10.62
IBRX 50	-4.03	-4.17	-8.14	14.54
IBRX 100	-4.39	-5.46	-9.72	12.04
ICO2	-4.78	-6.41	-10.96	-11.75
IGC TRADE	-4.50	-5.74	-9.99	12.94
IGC - NM	-4.90	-8.12	-14.29	-2.92
ISE	-6.66	-13.77	-18.05	-14.68

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

Volatilidade ISE e Outros Indicadores

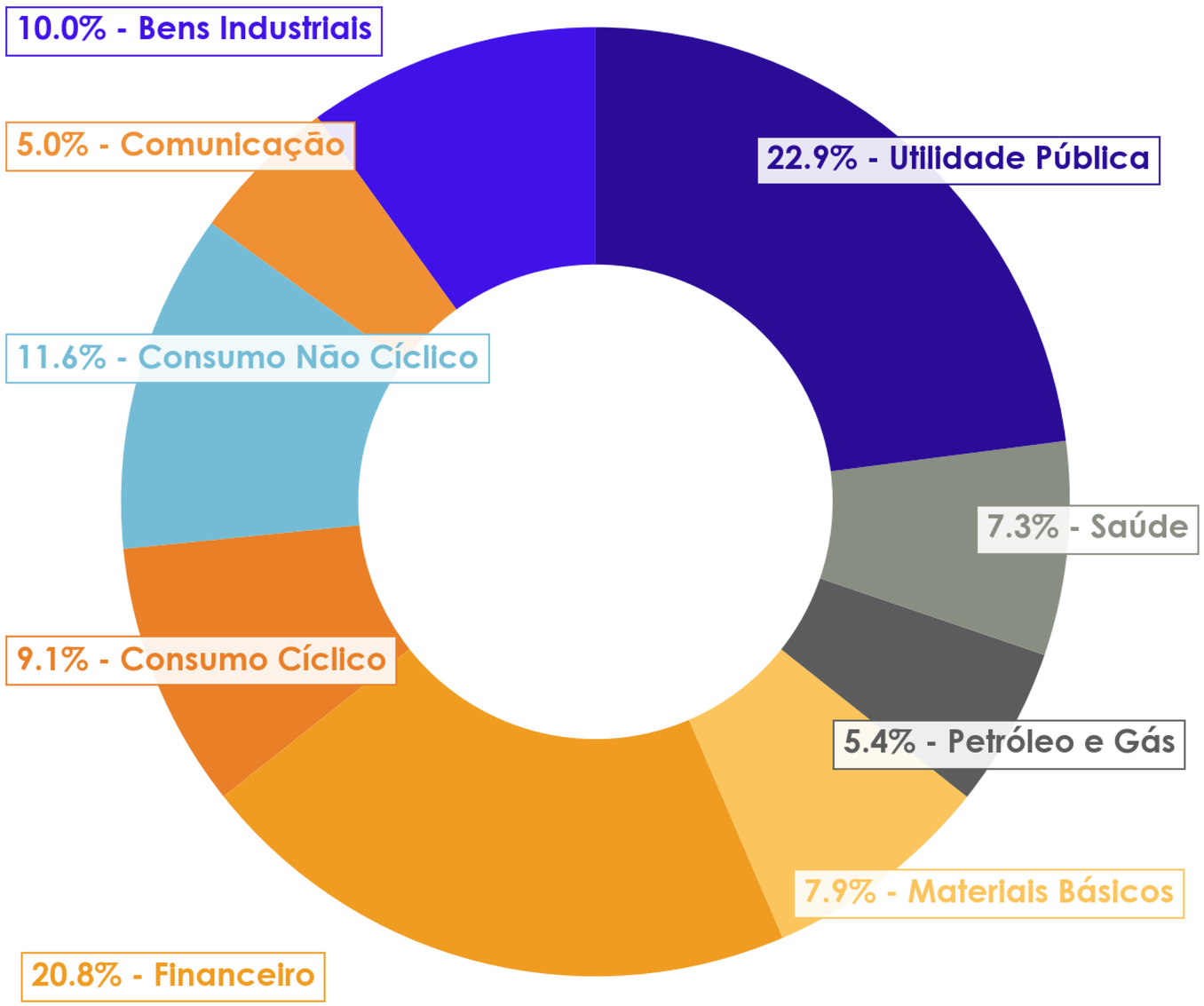


Variação Índice	Variação - Mês (%)*	Variação - Ano (%)**
IGPTW B3	12.79	85.11
IBOV	35.37	65.39
IBRX 50	34.21	59.31
IBRX 100	35.35	65.38
ICO2	23.31	77.39
IGC TRADE	33.17	68.03
IGC - NM	26.10	67.25
ISE	23.80	95.73

*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

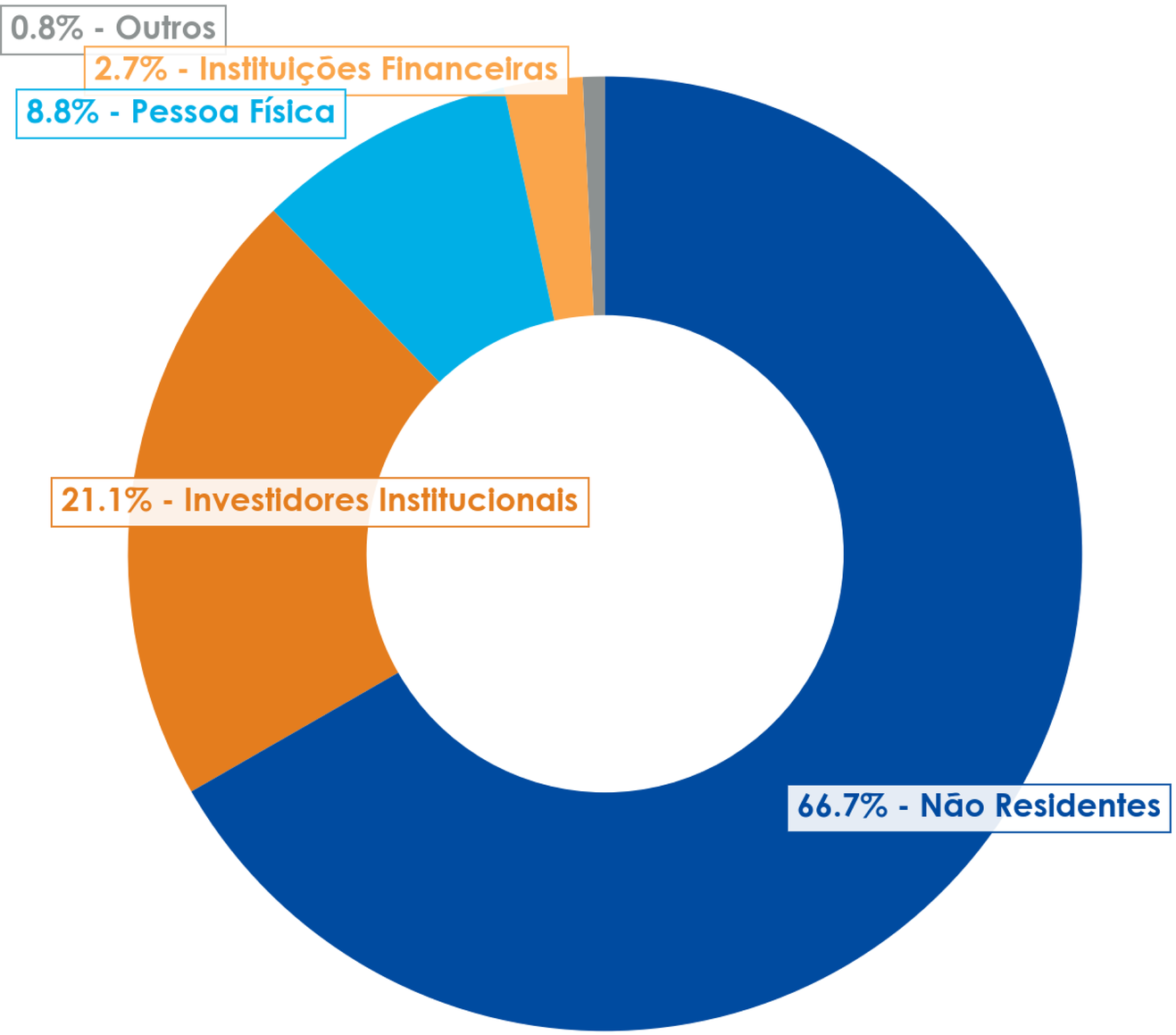


Composição ISE - TOP 15 Ativos

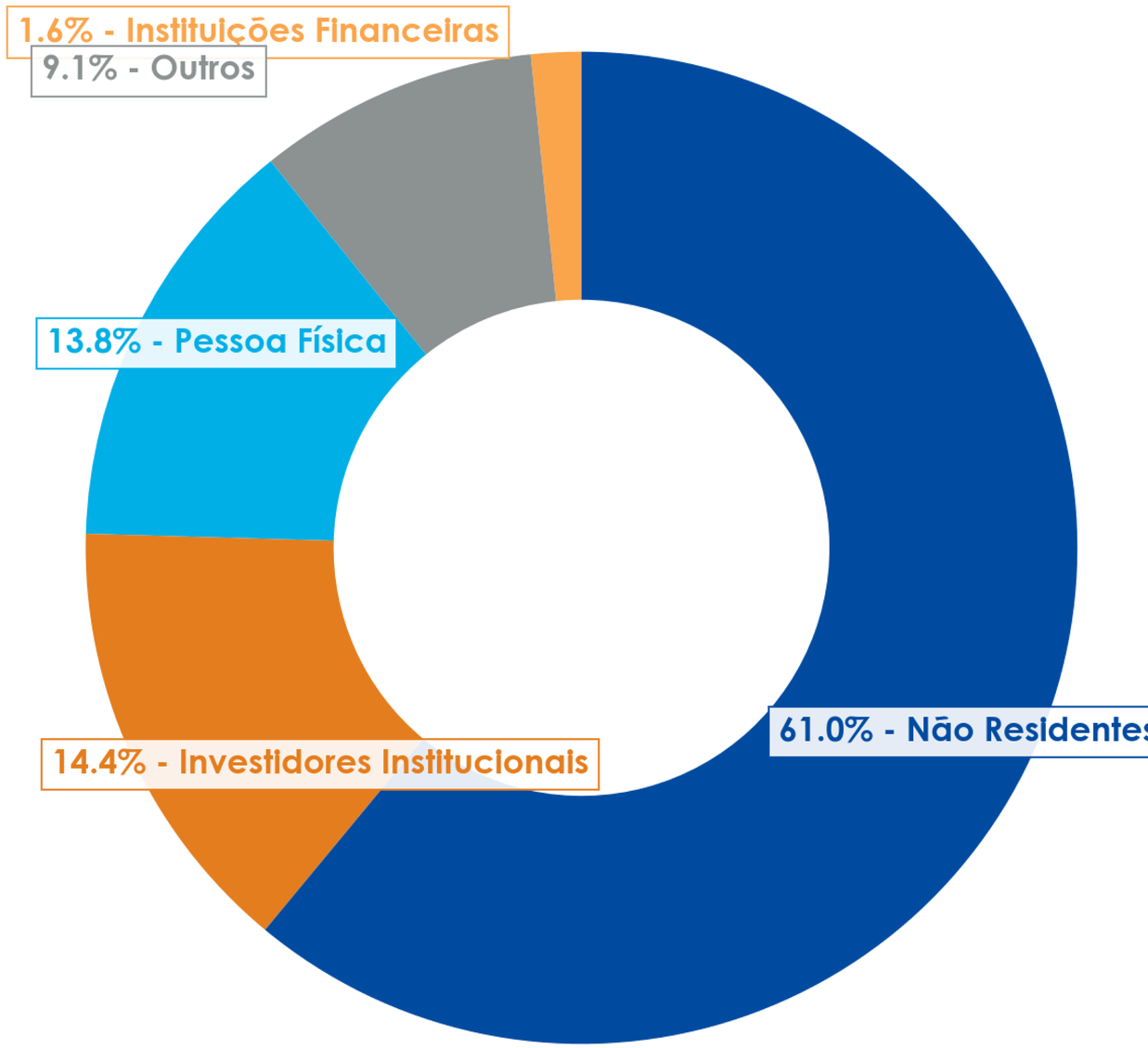
Ticker	Setor Econômico	% Mercado
SUZB3	Materiais Básicos	3.12
KLBN11	Materiais Básicos	3.00
VIVT3	Comunicação	2.69
NTCO3	Consumo Não Cíclico	2.55
CMIG4	Utilidade Pública	2.53
WEGE3	Bens Industriais	2.53
CPLE6	Utilidade Pública	2.46
BRFS3	Consumo Não Cíclico	2.44
ISAE4	Utilidade Pública	2.42
TIMS3	Comunicação	2.35
BBAS3	Financeiro	2.35
STBP3	Bens Industriais	2.35
EGIE3	Utilidade Pública	2.32
LREN3	Consumo Cíclico	2.29
ELET3	Utilidade Pública	2.26

Participação por Tipo Investidor*

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



Participação na posição em custódia (R$) – December/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	2.24	14.68	61.78	27.95	110.61	3.12
KLBN11	Materiais Básicos	5.41	22.31	23.20	19.27	85.42	3.00
VIVT3	Comunicação	-4.09	-7.37	46.77	22.73	105.62	2.69
NTCO3	Consumo Não Cíclico	-8.07	-21.30	12.76	37.76	75.84	2.55
CMIG4	Utilidade Pública	-4.96	42.18	11.11	25.42	100.47	2.53
WEGE3	Bens Industriais	-2.03	45.53	52.77	25.35	100.52	2.53
CPLE6	Utilidade Pública	-3.71	-7.78	9.15	20.70	88.16	2.46
BRFS3	Consumo Não Cíclico	2.66	88.75	25.36	39.57	64.61	2.44
ISAE4	Utilidade Pública	-4.76	-13.17	23.01	21.38	-	2.42
TIMS3	Comunicação	-6.91	-13.69	14.48	24.81	115.56	2.35
BBAS3	Financeiro	-1.74	-4.04	24.17	16.96	69.28	2.35
STBP3	Bens Industriais	2.78	69.77	13.13	35.71	105.93	2.35
EGIE3	Utilidade Pública	-5.79	-16.71	35.50	18.26	107.35	2.32
LREN3	Consumo Cíclico	-10.26	-19.96	12.12	42.83	90.32	2.29
ELET3	Utilidade Pública	1.81	-16.64	34.13	23.87	79.20	2.26
ENEV3	Utilidade Pública	-8.83	-22.63	10.53	23.38	73.55	2.24

*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	-4.79	-2.93	30.73	18.39	78.89	2.22
ITSA4	Financeiro	-4.09	-4.64	8.83	18.50	86.65	2.22
B3SA3	Financeiro	11.45	-26.67	10.32	27.75	78.19	2.22
ABEV3	Consumo Não Cíclico	-2.69	-9.78	11.74	20.32	97.74	2.21
RADL3	Saúde	-8.22	-24.17	22.00	25.52	112.62	2.16
SANB11	Financeiro	-4.45	-21.99	23.82	21.78	86.29	2.13
BBDC4	Financeiro	-8.33	-28.11	11.56	27.29	92.20	2.11
BPAC11	Financeiro	-9.21	-25.67	27.20	0.00	-	2.11
RAIL3	Bens Industriais	-8.28	-21.91	17.84	25.86	98.63	2.11
CCRO3	Bens Industriais	-7.80	-25.83	10.17	23.74	93.83	2.10
RDOR3	Saúde	-5.29	-9.50	25.42	30.46	71.12	2.06
PSSA3	Financeiro	-3.41	31.61	36.55	21.56	94.56	1.86
ALOS3	Financeiro	-7.43	-26.51	18.11	22.65	77.86	1.80
VBBR3	Petróleo e Gás	-12.28	-15.75	17.84	26.56	75.01	1.72
CPFE3	Utilidade Pública	-3.16	-10.95	31.59	17.60	77.77	1.65
CSAN3	Petróleo e Gás	-19.92	-56.37	8.16	31.47	100.77	1.60

*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
FLRY3	Saúde	-6.91	-29.82	12.07	21.98	76.08	1.58
SAPR11	Utilidade Pública	-8.13	-0.03	27.79	24.86	105.43	1.54
AMBP3	Utilidade Pública	-19.25	700.00	130.00	114.96	233.18	1.54
ASAI3	Consumo Não Cíclico	-14.70	-58.39	5.63	43.25	97.81	1.43
UGPA3	Petróleo e Gás	-11.48	-38.61	15.88	30.21	99.05	1.43
HYPE3	Saúde	-5.81	-47.03	18.09	34.21	116.96	1.39
CYRE3	Consumo Cíclico	-7.88	-27.55	16.95	34.01	89.38	1.26
AURE3	Utilidade Pública	-11.05	-31.99	8.77	18.31	108.54	1.23
CSMG3	Utilidade Pública	-16.50	15.52	20.82	27.94	92.55	1.06
AZZA3	Consumo Cíclico	-17.99	-52.90	29.58	38.08	-	1.03
NEOE3	Utilidade Pública	-1.27	-6.41	18.91	20.60	78.90	1.03
IGTI11	Financeiro	-9.82	-26.90	17.27	24.93	87.32	1.03
SLCE3	Consumo Não Cíclico	0.52	-2.79	17.50	22.74	92.67	0.96
CRFB3	Consumo Não Cíclico	-13.72	-55.65	5.43	45.65	97.65	0.80
USIM5	Materiais Básicos	-13.36	-40.76	5.32	44.35	146.18	0.76
RAIZ4	Petróleo e Gás	-18.18	-45.97	2.16	33.38	77.02	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
YDUQ3	Consumo Cíclico	-7.57	-61.18	8.55	50.24	79.26	0.67
SRNA3	Utilidade Pública	-12.84	-46.13	5.50	37.37	74.73	0.65
MGLU3	Consumo Cíclico	-28.02	-69.72	6.50	60.84	78.93	0.64
VAMO3	Consumo Cíclico	-10.90	-48.77	4.75	50.91	105.16	0.63
MRVE3	Consumo Cíclico	0.57	-52.72	5.31	48.08	89.14	0.56
COGN3	Consumo Cíclico	-15.50	-68.77	1.09	56.78	123.46	0.55
BPAN4	Financeiro	-8.06	-23.91	6.34	31.77	80.96	0.54
DXCO3	Materiais Básicos	-17.17	-24.95	5.96	38.93	86.61	0.51
MYPK3	Consumo Cíclico	-3.84	-7.71	11.28	36.11	102.03	0.41
ECOR3	Bens Industriais	-22.91	-53.77	4.24	46.05	106.84	0.40
BEEF3	Consumo Não Cíclico	-12.99	-31.86	5.09	37.83	87.94	0.38
GRND3	Consumo Cíclico	-5.79	-25.97	4.88	24.02	82.71	0.37
MDIA3	Consumo Não Cíclico	-9.45	-47.65	20.05	28.41	69.84	0.37
AZUL4	Bens Industriais	-28.19	-77.89	3.54	74.81	95.01	0.31
PCAR3	Consumo Não Cíclico	-3.41	-37.19	2.55	69.71	123.73	0.27
CBAV3	Materiais Básicos	-26.14	-8.04	4.69	53.82	99.83	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
CEAB3	Consumo Cíclico	-23.84	2.81	8.05	61.55	81.13	0.24
SIMH3	Financeiro	-24.03	-63.55	3.51	54.52	115.56	0.22
RANI3	Materiais Básicos	-3.81	-33.73	6.82	28.95	92.23	0.20
CAML3	Consumo Não Cíclico	-18.30	-28.43	5.85	34.56	78.46	0.16
GUAR3	Consumo Cíclico	-11.19	-3.76	6.19	60.39	87.18	0.14
MOVI3	Consumo Cíclico	-29.60	-68.91	3.54	56.25	100.05	0.12
JSLG3	Bens Industriais	-14.09	-53.22	5.41	46.12	107.68	0.10
DASA3	Saúde	-15.93	-80.25	1.90	68.31	96.47	0.08
AERI3	Bens Industriais	7.53	-68.28	5.71	105.86	149.94	0.08
BHIA3	Consumo Cíclico	-22.31	-74.60	2.89	80.25	108.46	0.07
MTRE3	Consumo Cíclico	-16.26	-48.87	2.90	47.96	87.65	0.05
GFSA3	Consumo Cíclico	-20.27	-86.70	1.18	95.07	74.22	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