



Boletim ISE

Junho 2015

Índice de
Sustentabilidade
Empresarial **ISE** 

Em junho, o Ibovespa teve um desempenho melhor do que o ISE. O Ibovespa apresentou valorização de +0,60%, enquanto o ISE sofreu recuo de -0,32%. Ao analisar o período de julho de 2014 até junho de 2015, verifica-se que o desempenho do ISE foi inferior, pois, apesar de os dois indicadores terem registrado desvalorizações, a do ISE (-1,31%) foi sensivelmente superior à queda do Ibovespa (-0,16%).

No mês, 29 dos 51 ativos integrantes da carteira do ISE, registraram alta, sendo que os melhores desempenhos couberam à Sul América UNT (+15,54%), AES Tietê ON (+13,70%) e Weg ON (+10,93%). Dos papéis que exibiram quedas, a mais acentuada foi a da Gerdau Met ON (-20,12%).

Em termos setoriais, 10 dos 19 setores registraram retornos médios positivos, com destaque para Previdência e Seguros (+15,54%). Do lado negativo, o maior recuo foi o de Siderurgia e Metalurgia (-16,76%).

De janeiro a junho de 2015, 29 dos papéis componentes da carteira do ISE valorizaram, sendo que as altas mais significativas foram as de Fibria ON (+99,20%), Klabin S/A UNT (+77,07%) e Eletropaulo PN (+65,49%).

A volatilidade de junho de 2015 do ISE (anualizada para 246 pregões) foi de 17,53% e a do Ibovespa foi de 21,31%.

As ações que compõem a carteira do ISE representaram 49,29% da capitalização bursátil total da BM&FBOVESPA, totalizando R\$ 1,17 trilhão.

Plataforma de Indicadores

A plataforma de indicadores do ISE está aberta ao público desde 26/06 e oferece estatísticas sobre o desempenho agregado das empresas que participaram do processo seletivo do índice desde o seu lançamento, em 2005.

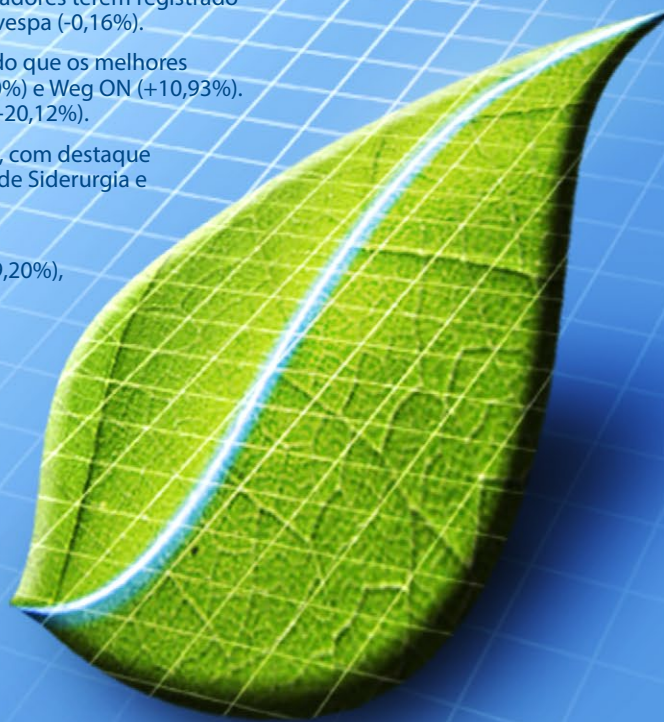
Workshop Temático

No dia 16/07, será realizado na FGV-SP o workshop temático sobre "Perspectiva Estratégica e Governança Corporativa para a Sustentabilidade".

Inscrições para o processo seletivo

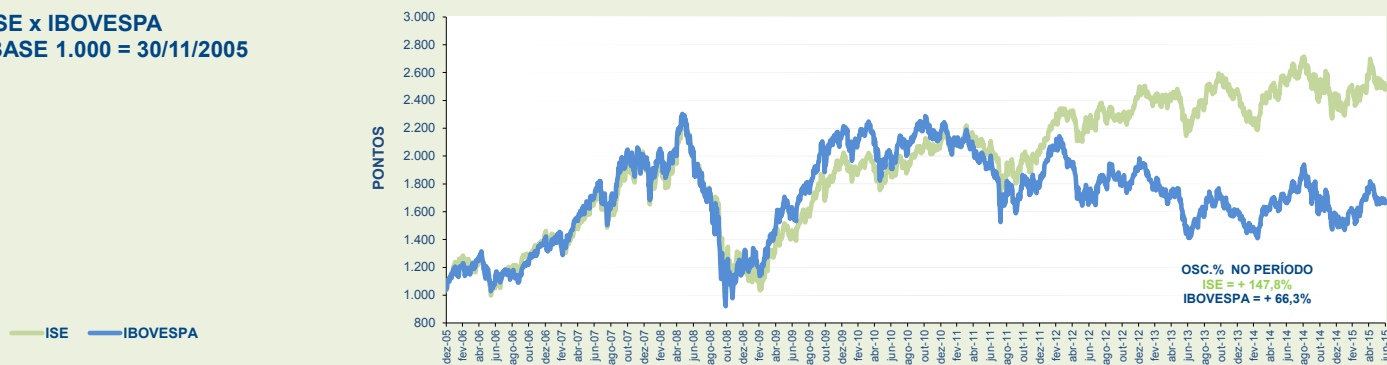
As inscrições para o Processo Seletivo ISE 2015/2016 continuam abertas até 14/08. Saiba mais em isebvmf.com.br.

Veja, a seguir, os gráficos e tabelas explicativos.

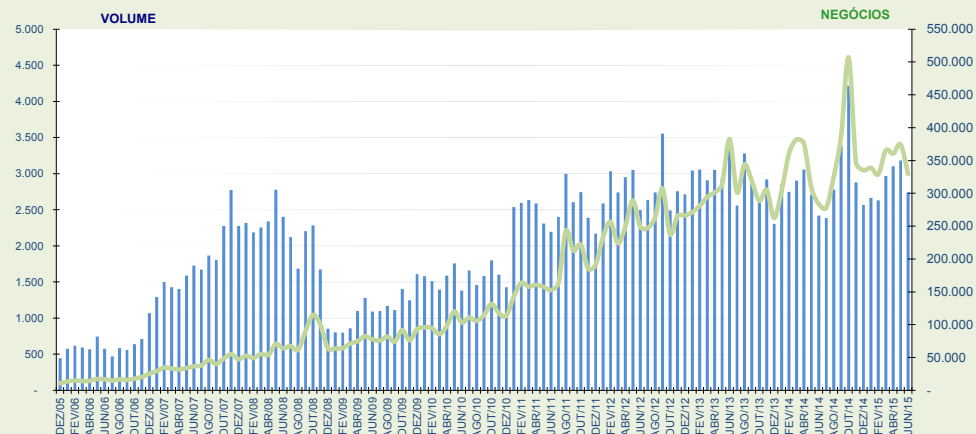


ISE x IBOVESPA

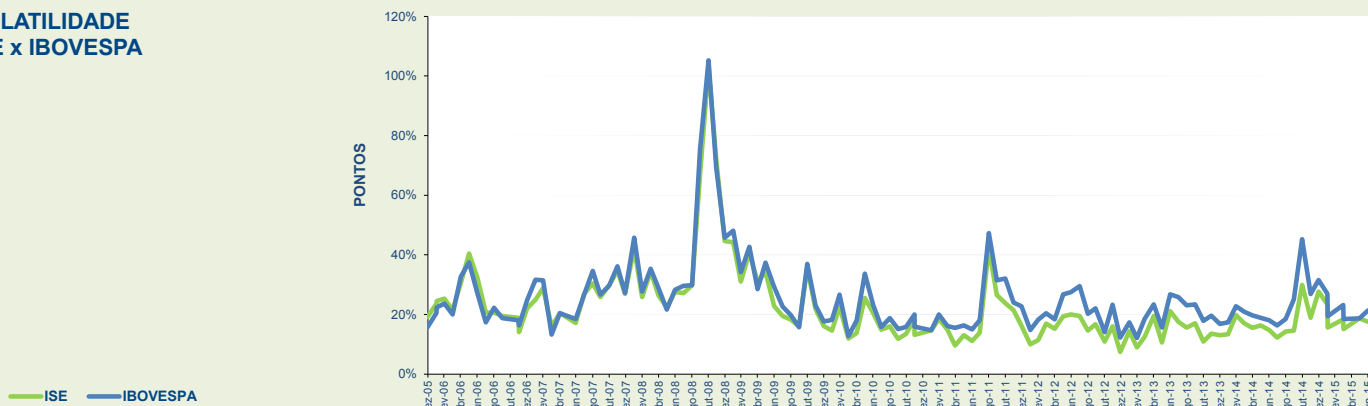
BASE 1.000 = 30/11/2005



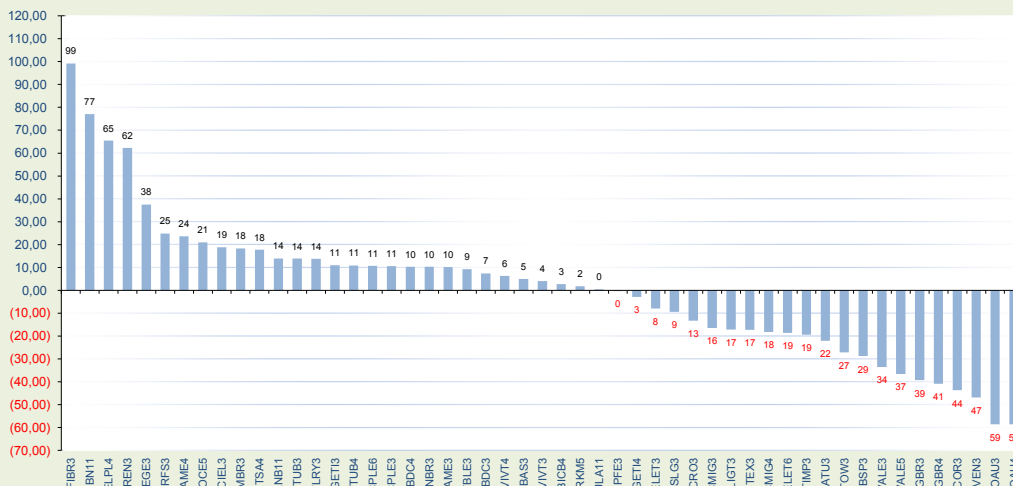
MÉDIAS DIÁRIAS DO VOLUME (R\$ MILHÕES) E Nº DE NEGÓCIOS



VOLATILIDADE ISE x IBOVESPA



LUCRATIVIDADE DAS AÇÕES ÚLTIMOS 12 MESES (Jul/2014 a Jun/2015)





CARTEIRA TEÓRICA DE 30/06/2015				LUCRATIVIDADE %	
CÓD. MEGA	NOME	TIPO	PART. %	MÊS MAI/2015	ANO 2015
GETI3	AES TIETE	ON	0,250	13,70	10,40
GETI4	AES TIETE	PN	0,576	2,94	-1,59
BTOW3	B2W DIGITAL	ON NM	0,321	-20,04	-9,14
BICB4	BICBANCO	PN N1	0,027	2,92	35,96
BBDC3	BRASESCO	ON ED N1	1,056	7,52	-0,87
BBDC4	BRASESCO	PN ED N1	3,965	1,76	-1,06
BBAS3	BRASIL	ON NM	1,130	7,92	7,00
BRKM5	BRASKEM	PNA N1	0,961	5,01	-18,05
BRFS3	BRF SA	ON NM	14,762	1,91	4,30
CCRO3	CCR SA	ON NM	3,521	-3,43	-2,91
CMIG3	CEMIG	ON N1	0,661	-15,90	-11,01
CMIG4	CEMIG	PN N1	2,420	-16,36	-6,85
CIEL3	CIELO	ON NM	8,817	9,55	27,60
COCE5	COELCE	PNA	0,197	0,39	6,71
CPLE3	COPEL	ON N1	0,137	10,00	-1,50
CPLE6	COPEL	PNB N1	0,929	6,65	-0,02
CPFE3	CPFL ENERGIA	ON NM	1,539	-0,47	7,44
DTEX3	DURATEX	ON NM	0,525	-9,25	-8,95
ECOR3	ECORODOVIAS	ON NM	0,407	6,90	-23,72
ELET3	ELETRORBRAS	ON N1	0,360	-8,84	1,38
ELET6	ELETRORBRAS	PNB N1	0,514	-9,12	4,56
ELPL4	ELETROPAULO	PN N2	0,442	8,74	105,43
EMBR3	EMBRAER	ON EJ NM	4,626	-0,70	-2,83
ENBR3	ENERGIAS BR	ON NM	0,726	9,51	29,91
EVEN3	EVEN	ON NM	0,188	-12,47	-35,95
FIBR3	FIBRIA	ON NM	2,549	-3,02	31,31
FLRY3	FLEURY	ON NM	0,308	6,08	12,73
GGBR3	GERDAU	ON N1	0,169	-14,98	-22,55
GGBR4	GERDAU	PN N1	1,833	-13,61	-20,88
GOAU3	GERDAU MET	ON N1	0,066	-20,12	-39,07
GOAU4	GERDAU MET	PN N1	0,483	-18,33	-43,15
ITSA4	ITAUSA	PN N1	1,745	1,19	7,57
ITUB3	ITAUNIBANCO	ON N1	0,488	2,36	5,65
ITUB4	ITAUNIBANCO	PN N1	5,257	-0,28	1,37
JSLG3	JSL	ON NM	0,175	6,30	-15,28
KLBN11	KLABIN S/A	UNT N2	1,953	0,47	31,68
LIGT3	LIGHT S/A	ON NM	0,441	-0,41	4,88
LAME3	LOJAS AMERIC	ON	0,567	5,41	1,68
LAME4	LOJAS AMERIC	PN	1,950	7,17	0,99
LREN3	LOJAS RENNER	ON EJ NM	3,894	5,72	49,74
NATU3	NATURA	ON NM	1,249	-3,94	-10,28
SBSP3	SABESP	ON NM	1,468	-11,05	-1,35
SANB11	SANTANDER BR	UNT	0,380	6,68	27,55
SULA11	SUL AMERICA	UNT N2	0,948	15,54	19,37
VIVT3	TELEF BRASIL	ON	0,315	-3,14	0,12
VIVT4	TELEF BRASIL	PN	4,035	-2,88	-0,46
TIMP3	TIM PART S/A	ON NM	2,233	8,70	-11,59
TBLE3	TRACTEBEL	ON NM	1,872	1,00	1,79
VALE3	VALE	ON N1	6,041	-8,78	-14,18
VALE5	VALE	PNA N1	7,606	-7,04	-16,28
WEGE3	WEG	ON EJ NM	2,918	10,93	25,88

CAPITALIZAÇÃO BURSÁTIL - 30/06/2015		
EMPRESA	EM R\$	EM US\$
ITAUNIBANCO	186.467.357.434	60.100.353.714
BRASESCO	142.576.102.571	45.953.749.298
VALE	90.425.025.719	29.144.919.010
CIELO	82.674.191.661	26.646.745.201
TELEF BRASIL	69.909.317.182	22.532.494.418
BRASIL	69.572.325.246	22.423.878.439
SANTANDER BR	63.985.917.741	20.623.321.647
ITAUSA	60.350.772.311	19.451.676.759
BRF SA	57.304.042.797	18.469.684.393
WEG	30.753.426.098	9.912.146.618
CCR SA	26.324.905.152	8.484.788.613
TIM PART S/A	24.791.372.585	7.990.515.240
FIBRIA	23.497.907.683	7.573.618.154
TRACTEBEL	22.317.255.544	7.193.081.784
CPFL ENERGIA	19.115.523.639	6.161.130.548
LOJAS AMERIC	18.967.903.463	6.113.551.042
KLABIN S/A	18.092.275.749	5.831.327.193
EMBRAER	17.519.402.941	5.646.684.375
CEMIG	14.946.692.605	4.817.473.282
LOJAS RENNER	14.445.870.845	4.656.053.260
GERDAU	12.100.110.496	3.899.990.491
NATURA	11.876.329.331	3.827.863.511
SABESP	11.277.912.839	3.634.987.700
BRASKEM	9.152.329.056	2.949.890.110
ELETRORBRAS	8.642.738.041	2.785.643.667
COPEL	7.925.423.167	2.554.445.680
AES TIETE	6.494.221.038	2.093.154.463
ENERGIAS BR	5.483.543.694	1.767.402.725
B2W DIGITAL	5.222.657.511	1.683.316.415
SUL AMERICA	5.168.952.477	1.666.006.729
DURATEX	4.832.005.080	1.557.405.105
ECORODOVIAS	4.329.917.870	1.395.577.216
LIGHT S/A	3.452.603.636	1.112.809.784
COELCE	3.163.658.981	1.019.679.940
FLEURY	2.861.731.348	922.365.548
ELETROPAULO	2.791.220.310	899.639.112
GERDAU MET	2.467.767.174	795.386.828
JSL	2.341.430.647	754.667.262
BICBANCO	1.903.930.268	613.656.375
EVEN	769.868.246	248.136.481
TOTAL = 40	1.166.295.940.176	375.909.218.132

VARIÇÃO %	NO MÊS	NO ANO	12 MESES	ACUM.
ISE	-0,33	1,94	-1,32	147,89
IBOVESPA	0,61	6,15	-0,16	66,31
IGC	0,55	3,95	2,01	137,75
IBRX 50	0,64	6,71	0,95	96,13

NOS ÚLTIMOS 12 MESES	
COD. MEGA	VOLATILIDADE
WEGE3	71,085
BTOW3	54,111
ELET3	51,936
BBAS3	51,739
ELPL4	51,185
ELET6	49,640
VALE3	46,915
BRKM5	46,002
GOAU3	45,263
CMIG3	44,367
GOAU4	44,068
EVEN3	44,043
BBDC4	43,751
CMIG4	42,775
VALE5	42,316
BBDC3	42,167
GGBR3	41,536
GGBR4	41,469
LIGT3	41,365
ECOR3	40,857
CCRO3	40,181
TIMP3	39,916
CPLE3	39,071
CPFE3	38,358
CPLE6	37,945
JSLG3	37,550
ENBR3	37,003
SBSP3	36,999
NATU3	36,047
ITSA4	35,977
ITUB4	35,240
SANB11	35,115
CIEL3	34,788
GETI4	34,007
FLRY3	33,747
SULA11	33,376
VIVT3	33,055
FIBR3	32,839
DTEX3	32,640
GETI3	31,890
LAME4	31,776
BICB4	30,999
TBLE3	30,695
LAME3	30,648
ITUB3	30,439
LREN3	29,550
VIVT4	28,929
EMBR3	28,414
BRFS3	24,931
COCE5	23,392
KLBN11	22,473

CARTEIRA TEÓRICA DE ABERTURA DE 01/06/2015				
COD. MEGA	PART. % (A)	LUC.% MAI/15 (B)	CONTRIBUIÇÃO NO ÍNDICE (A*B)	
AES TIETE ON	0,219	13,70	0,030	
AES TIETE PN	0,566	2,94	0,017	
B2W DIGITAL ON	0,386	-20,04	(0,077)	
BICBANCO PN	0,026	2,92	(0,001)	
BRASESCO ON	1,003	7,52	0,075	
BRASESCO PN	3,888	1,76	0,069	
BRASIL ON	1,076	7,92	0,085	
BRASKEM PNA	0,907	5,01	0,045	
BRF SA ON	14,354	1,91	0,274	
CCR SA ON	3,651	-3,43	(0,125)	
CEMIG ON	0,805	-15,90	(0,128)	
CEMIG PN	2,967	-16,36	(0,485)	
CIELO ON	8,390	9,55	0,801	
COELCE PNA	0,197	0,39	0,001	
COPEL ON	0,127	10,00	0,013	
COPEL PNB	0,907	6,65	0,060	
CPFL ENERGIA ON	1,586	-0,47	(0,007)	
DURATEX ON	0,557	-9,25	(0,052)	
ECORODOVIAS ON	0,399	6,90	0,027	
ELETRORBRAS ON	0,409	-8,84	(0,036)	
ELETRORBRAS PNB	0,572	-9,12	(0,052)	
ELETROPAULO PN	0,420	8,74	0,037	
EMBRAER ON	4,648	-0,70	(0,032)	
ENERGIAS BR ON	0,674	9,51	0,064	
EVEN ON	0,211	-12,47	(0,026)	
FIBRIA ON	2,601	-3,02	(0,078)	
FLEURY ON	0,295	6,08	0,018	
GERDAU ON	0,195	-14,98	(0,029)	
GERDAU PN	2,076	-13,61	(0,283)	
GERDAU MET ON	0,084	-20,12	(0,017)	
GERDAU MET PN	0,584	-18,33	(0,107)	
ITAUSA PN	1,714	1,19	0,020	
ITAUNIBANCO ON	0,473	2,36	0,011	
ITAUNIBANCO PN	5,187	-0,28	(0,014)	
JSL ON	0,173	6,30	0,011	
KLABIN S/A UNT	1,944	0,47	0,009	
LIGHT S/A ON	0,457	-0,41	(0,002)	
LOJAS AMERIC ON	0,539	5,41	0,029	
LOJAS AMERIC PN	1,884	7,17	0,135	
LOJAS RENNER ON	3,579	5,72	0,205	
NATURA ON	1,302	-3,94	(0,051)	
SABESP ON	1,694	-11,05	(0,187)	
SANTANDER BR UNT	0,357	6,68	0,024	
SUL AMERICA UNT	0,860	15,54	0,134	
TELEF BRASIL ON	0,318	-3,14	(0,010)	
TELEF BRASIL PN	4,133	-2,88	(0,119)	
TIM PART S/A ON	2,061	8,70	0,179	
TRACTEBEL ON	1,901	1,00	0,019	
VALE ON	6,245	-8,78	(0,548)	
VALE PNA	7,771	-7,04	(0,547)	
WEG ON	2,630	10,93	0,288	
CONTRIBUIÇÃO TOTAL			(0,333)	

NOS ÚLTIMOS 12 MESES	
COD. MEGA	BETA EM RELAÇÃO AO IBOVESPA
BBAS3	1,867
BBDC4	1,614
ELET6	1,521
ELET3	1,519
VALE3	1,458
BBDC3	1,455
ITUB4	1,422
GOAU4	1,382
CPFE3	1,368
ITSA4	1,335
CCRO3	1,299
VALE5	1,279
GGBR4	1,261
EVEN3	1,243
CMIG4	1,205
ECOR3	1,198
CMIG3	1,195
ITUB3	1,150
GOAU3	1,140
CPLE6	1,133
ELPL4	1,126
GGBR3	1,116
LIGT3	1,081
ENBR3	1,058
SBSP3	1,056
LAME4	1,032
CPLE3	1,021
NATU3	0,996
TBLE3	0,979
DTEX3	0,909
LAME3	0,898
LREN3	0,877
TIMP3	0,852
VIVT4	0,796
CIEL3	0,785
SANB11	0,778
BRFS3	0,777
JSLG3	0,746
VIVT3	0,708
BRKM5	0,705
GETI4	0,681
GETI3	0,626
SULA11	0,614
BTOW3	0,500
FLRY3	0,471
KLBN11	0,415
EMBR3	0,380
COCE5	0,341
FIBR3	0,122
BICB4	0,086
WEGE3	0,084

INFORMAÇÕES DA CARTEIRA - 30/06/2015	
% DE MAIOR PESO	14,76
% DE MENOR PESO	0,03
% DAS 5 MAIORES	42,48
% DAS 10 MAIORES	62,52

LUCRATIVIDADE MÉDIA % POR NOVO (NO MÊS)	
Água e Saneamento	(11,05)
Alimentos	1,91
Comércio	(12,47)
Construção e Engenharia	(0,43)
Energia Elétrica	0,13
Intermediários Financeiros	3,76
Madeira e Papel	(3,93)
Máquinas e Equipamentos	10,93
Material de Transporte	(0,70)
Mineração	(7,91)
Previdência e Seguros	15,54
Prods. de Uso Pessoal e de Limpeza	(3,94)
Químicos	5,01
Saúde	6,08
Serviços Financeiros Diversos	9,55
Siderurgia e Metalurgia	(16,76)
Telefonia Fixa	(3,01)
Telefonia Movel	8,70
Transporte	3,25