



Quantidade de empresas e ações na carteira do Ibovespa são recorde histórico. Comportamento histórico de Dividend Yield ponderado do Ibovespa, IBRX-100 e IFIX.

Com as carteiras históricas dos índices da B3 podemos calcular a média ponderada de diversos índices, como por exemplo o Dividend Yield.

O relatório a seguir apresenta algumas curiosidades dos índices Ibovespa, IBRX 100 e IFIX.

A base de dados da Economática tem as séries históricas dos índices da B3, o que possibilita a realização de qualquer cálculo com indicadores disponíveis na plataforma ponderado pelas participações.

Ibovespa

No dia 6 de setembro a carteira teórica dos índices da B3 foi rebalanceada e a carteira passou a contar com 91 ativos, que é a maior quantidade já vista no Ibovespa. Em dezembro de 1999 o índice contava com 46 papéis, que é praticamente a metade do número de ativos que temos atualmente.

Entre março de 2006 e março de 2014 a quantidade de ações da carteira teórica do Ibovespa teve crescimento contínuo. De abril de 2014 até novembro de 2017 a quantidade de ações da carteira teve queda expressiva, retomando o crescimento a partir desta data até setembro de

2021.



Quais são as ações presentes em todas os meses desde dezembro de 1999

Na tabela abaixo temos as 11 ações que sempre estiveram presentes na carteira teórica do Ibovespa desde dezembro de 1999.

A maior participação da ação da Petrobras preferencial PETR4 desde 1999 foi de 37,59% em março de 2003 e a menor de 0,05% em maio de 2000.

Doze ações já tiveram participação na carteira do Ibovespa de mais de 10% em algum momento de dezembro de 1999 até setembro de 2021. As doze ações pertencem a nove empresas, já que três empresas têm duas ações cada.

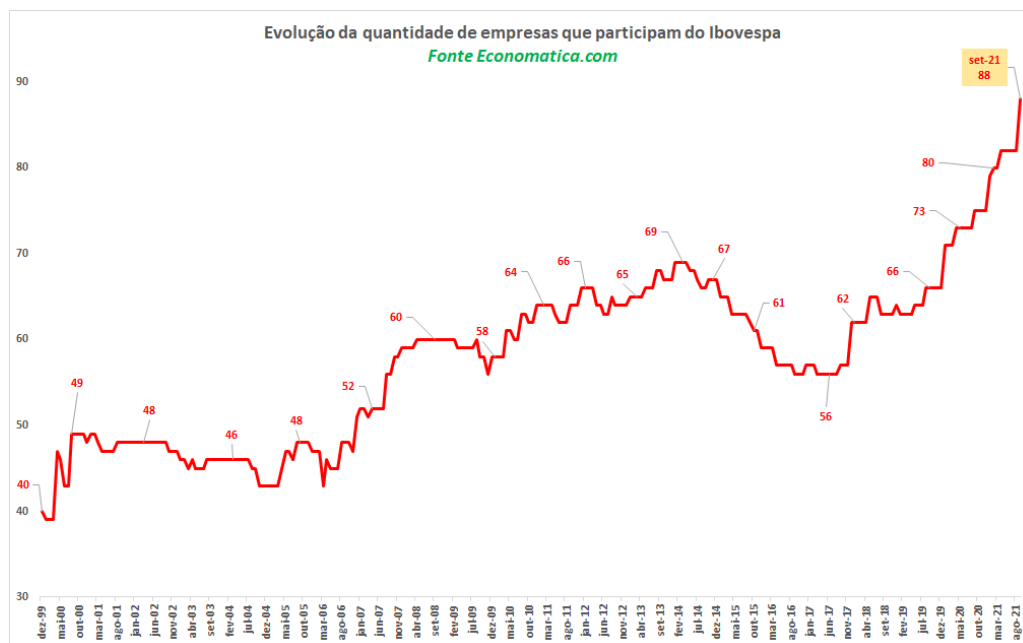
De dezembro de 1999 até setembro de 2021, 185 ações já fizeram parte da carteira do Ibovespa.

Ações presentes no Ibovespa em todos os meses desde dezembro de 1999

Empresa	Classe	Codigo	Qdade meses	% participação	
				Máximo	Mínimo
Petrobras	PN	PETR4	262	37,59	0,05
Embraer	ON	EMBR3	262	16,67	0,26
Petrobras	ON	PETR3	262	14,12	0,01
Usiminas	PNA	USIM5	262	13,68	0,06
Bradesco	PN	BBDC4	262	12,24	0,01
ItauUnibanco	PN	ITUB4	262	11,61	0,01
Itausa	PN	ITSA4	262	9,29	1,73
Sid Nacional	ON	CSNA3	262	7,54	0,002
Brasil	ON	BBAS3	262	4,39	0,001
Braskem	PNA	BRKM5	262	3,82	0,001
Cemig	PN	CMIG4	262	2,57	0,002
Quantidade de ações no Ibovespa desde Dez/99				185	
<i>Fonte Economática.com</i>					

Quantas empresas estão presentes na carteira do Ibovespa

Sabemos que muitas empresas participam da carteira dos índices com mais de um ativo, por exemplo Petrobras com a ação ordinária e preferencial. Nesse sentido quisemos saber quantas são as empresas que fazem parte da carteira historicamente. Em setembro temos 88 empresas que fazem parte do Ibovespa, que também é o maior número de empresas historicamente.



Quais são as empresas presentes em todas os meses desde dezembro de 1999

Na tabela abaixo listamos as treze empresas que tiveram pelo menos uma ação na carteira do Ibovespa de dezembro de 1999 até setembro de 2021.

A Petrobras com as suas ações preferencial e ordinária já concentrou 49,8% da participação no Ibovespa, fato que aconteceu em maio de 2001.

A Vale já teve 37,7% de participação no Ibovespa em janeiro de 2000.

O Ibovespa já teve 155 empresas com alguma ação na sua carteira no período do levantamento.

Empresas presentes no Ibovespa em todos os meses desde dezembro de 1999			
Empresa	Qdade meses	% participação	
		Máximo	Mínimo
Petrobras	262	49,8	0,06
Vale	262	37,7	4,23
Embraer	262	17,8	0,26
Usiminas	262	13,7	0,06
Bradesco	262	12,2	0,01
ItauUnibanco	262	11,6	0,01
Ambev S/A	262	9,3	0,00
Itausa	262	9,3	1,732
Sid Nacional	262	7,5	0,00
Brasil	262	4,4	0,00
Braskem	262	3,8	0,00
Klabin S/A	262	3,4	0,27
Cemig	262	2,6	0,00
Qdade empresass no Ibovespa desde Dez/99			155
<i>Fonte Economatica.com</i>			

Quais são os setores mais representativos no Ibovespa

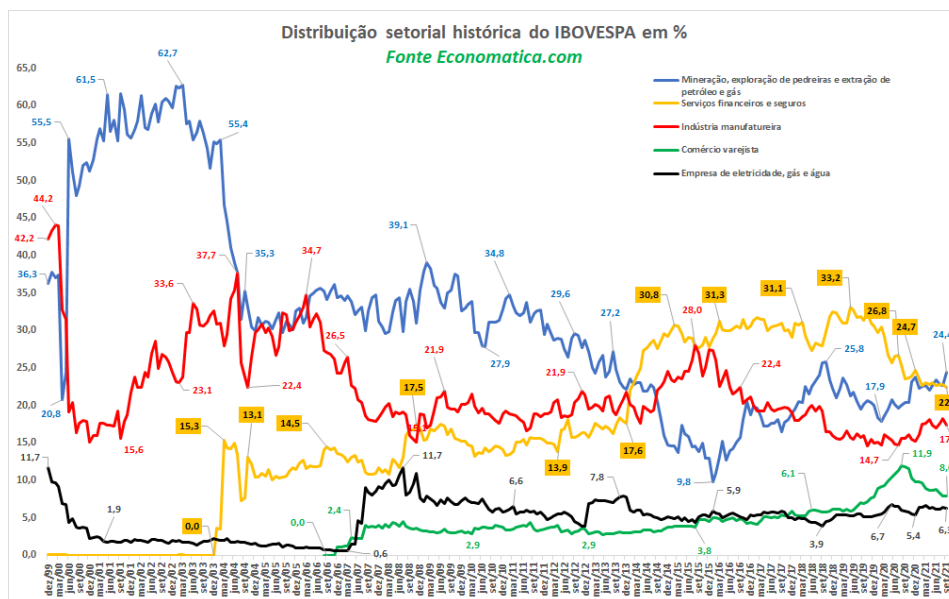
Dividimos as 185 ações presentes na carteira do Ibovespa de dezembro de 1999 em diante dentro de quatorze setores conforme a classificação setorial NAICS no nível 1. Não utilizamos as classificações atuais da B3, porque elas não existiam em anos anteriores e acabaria distorcendo a amostra.

O setor de Mineração, exploração de pedreiras e extração de petróleo e gás teve até oito ações no período analisado e no dia 6 de setembro de 2021 responde por 24,4% do Ibovespa, ultrapassando o setor de Serviços financeiros e seguros que na mesma data responde por 22,5% e tem dezoito ações no período da amostra.

O terceiro setor mais representativo é o de indústria manufatureira com 17,3% com 38 ações no período analisado.

O quarto setor com 8,0% de participação é o de comércio varejista que teve até doze ações presentes em algum momento da amostra.

O quinto setor que têm vinte e três ações é o de Empresa de eletricidade, gás e água que no dia 6 de setembro de 2021 concentra 6,3% do Ibovespa.



Dividend Yield ponderado dos índices Ibovespa, IBRX100 e IFIX

No gráfico a seguir encontramos a evolução do Dividend Yield ponderado dos índices Ibovespa, IBRX100 e IFIX entre agosto de 2012 e setembro de 2021.

O Dividend Yield (DY) é calculado da seguinte maneira:

= (dividendos e JCP's distribuídos no período de 12 meses) / preço da ação em (d-12 meses).

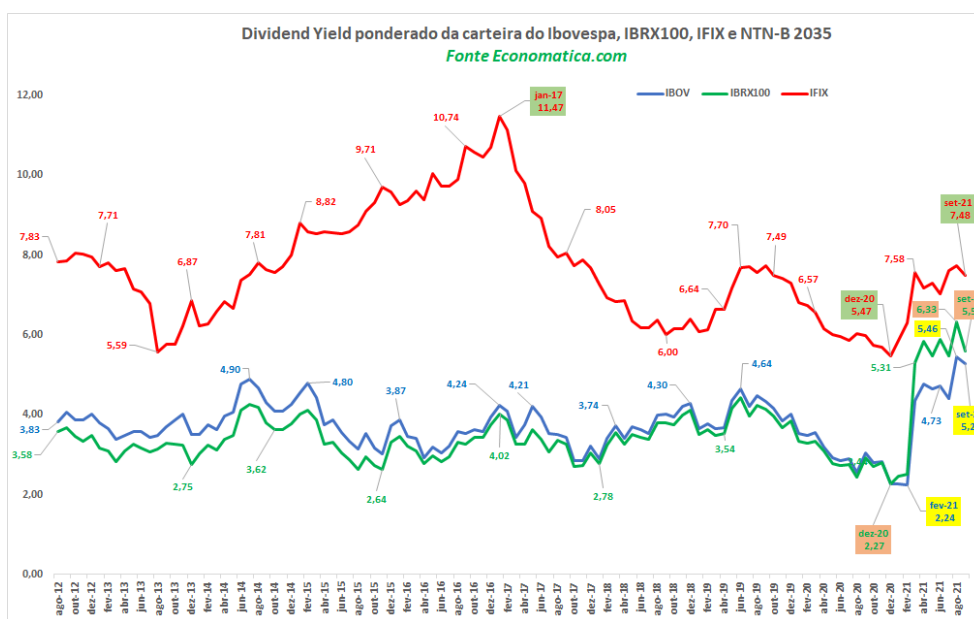
O IFIX tem o melhor DY ponderado em todo o período da amostra e no dia 6 de setembro de 2021 tem 7,48% de DY contra 5,59% do IBRX-100 e 5,28% do Ibovespa.

O maior DY do IFIX aconteceu em janeiro de 2017 com 11,47% e o menor em dezembro de 2020 com 5,47% de DY.

O IBRX 100 atingiu o melhor valor em agosto de 2021 com 6,33% de DY e o menor em dezembro de 2020 com 2,27% de DY.

O Ibovespa atinge o melhor registro da amostra em agosto de 2021 com

5,46% e o pior momento em fevereiro de 2021 com 2,24% de DY.

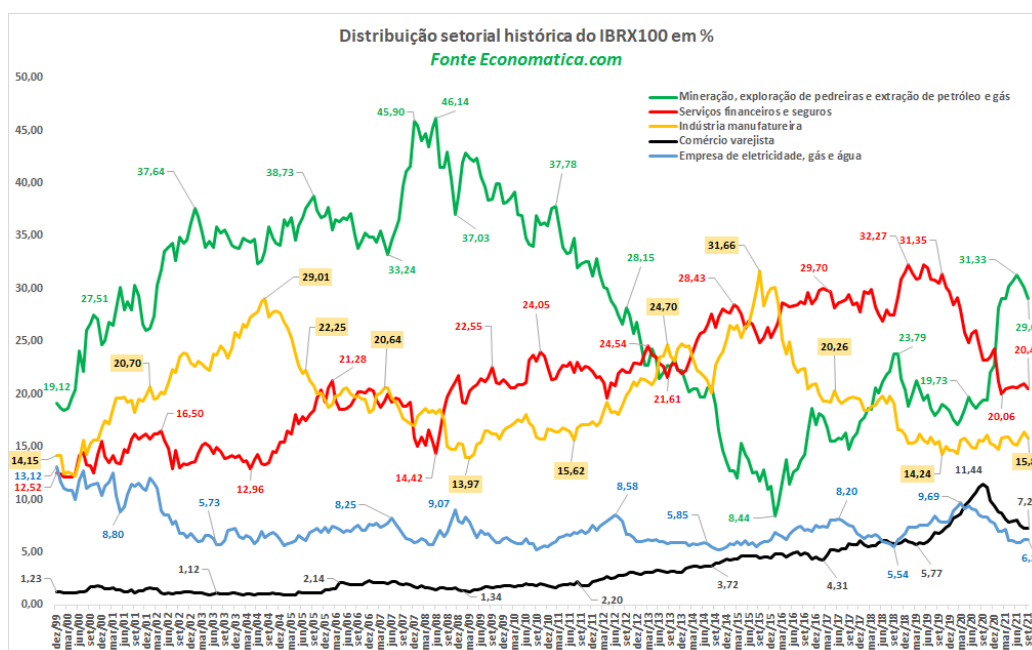


O IBRX100 – Evolução da composição setorial

No gráfico abaixo visualizamos a composição setorial do índice IBRX 100 de dezembro de 1999 até setembro de 2021.

O setor de mineração, exploração de pedreiras e extração de petróleo e gás tem a maior participação com 29,07% seguido pelo setor de serviços financeiros e seguros com 20,47%.

Na terceira posição temos o setor de indústria manufatureira com 15,82% e comércio varejista com 7,27% ocupa a quarta posição, seguido por empresas de eletricidade, gás e água com 6,21%.



Caso deseje personalizar o estudo e seja usuário da nossa solução, entre em contato com nosso suporte pelo telefone 011 40813800 ou pelo e-mail info@economica.com.br para que possamos lhe auxiliar na elaboração do estudo. Se ainda não for usuário da nossa plataforma solicite um trial.

PEDIR DEMONSTRAÇÃO

Receba nossos estudos pelas redes sociais.



Caso você queira sair da lista de e-mails [clique aqui](#).