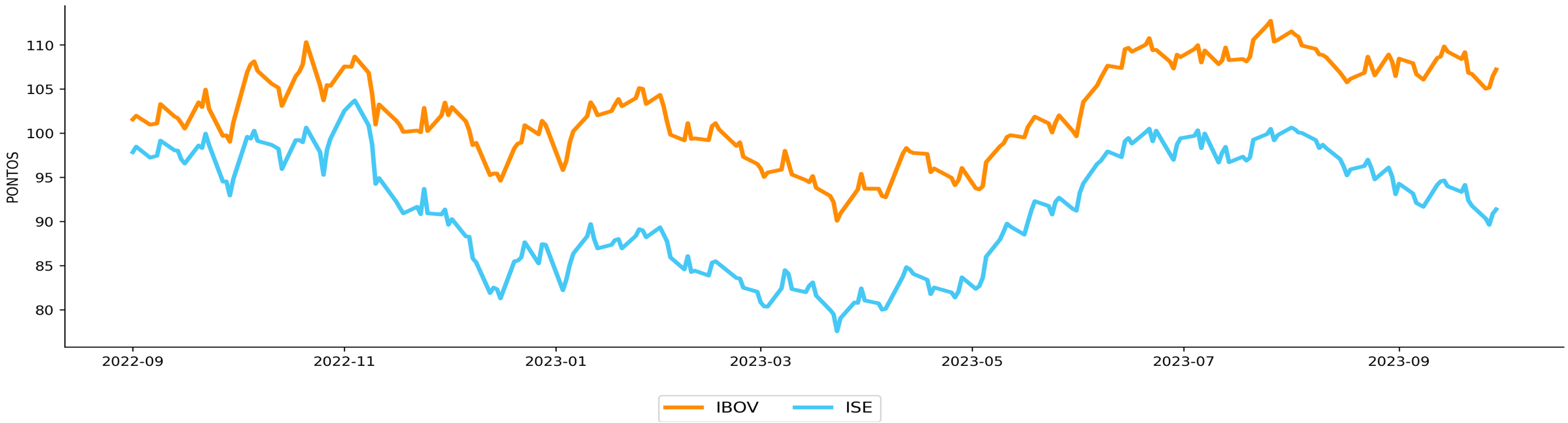
Boletim Mensal de ISE

September/2023

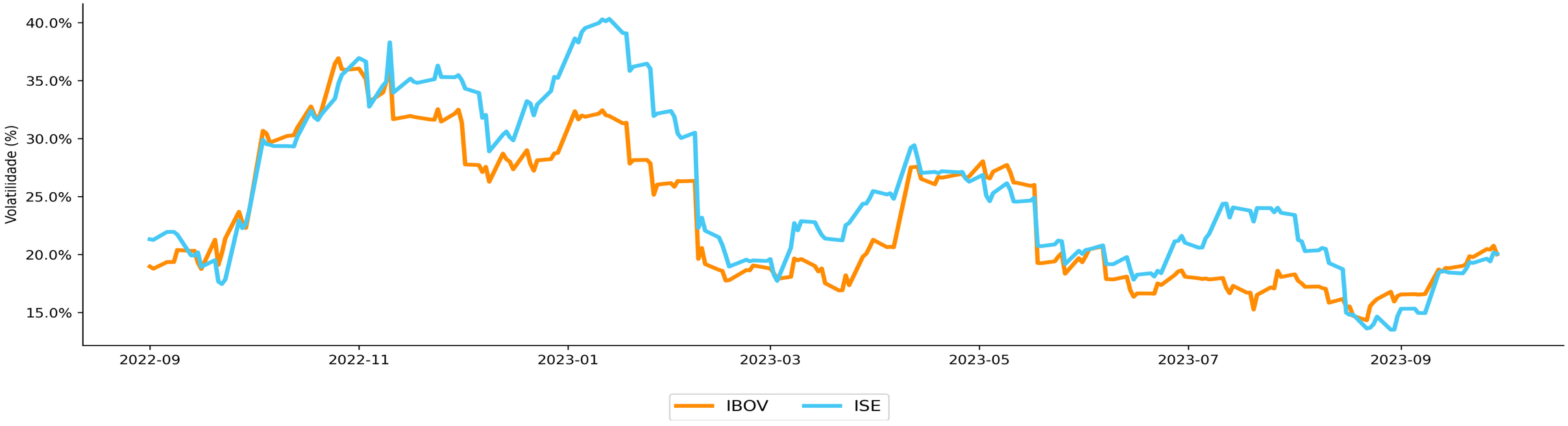
Comparativo ISE e Outros Indicadores



Indice	Variação MoM (%)	Variação YTD (%)	Variação 12M (%)	Variação Total (%)*
IGPTW B3	-2.94	2.29	-11.88	-10.32
IBOV	0.71	11.90	5.93	7.22
IBRX 50	1.21	10.14	5.32	8.97
IBRX 100	0.84	10.87	5.09	7.97
ICO2	-1.12	14.29	1.53	-14.79
IGC TRADE	0.96	12.36	6.01	9.59
IGC - NM	-0.29	6.34	2.45	-0.40
ISE	-1.84	11.15	-3.62	-8.63

*Mês base para cálculo da Variação Total fixado em Novembro de 2020.

Volatilidade ISE e Outros Indicadores

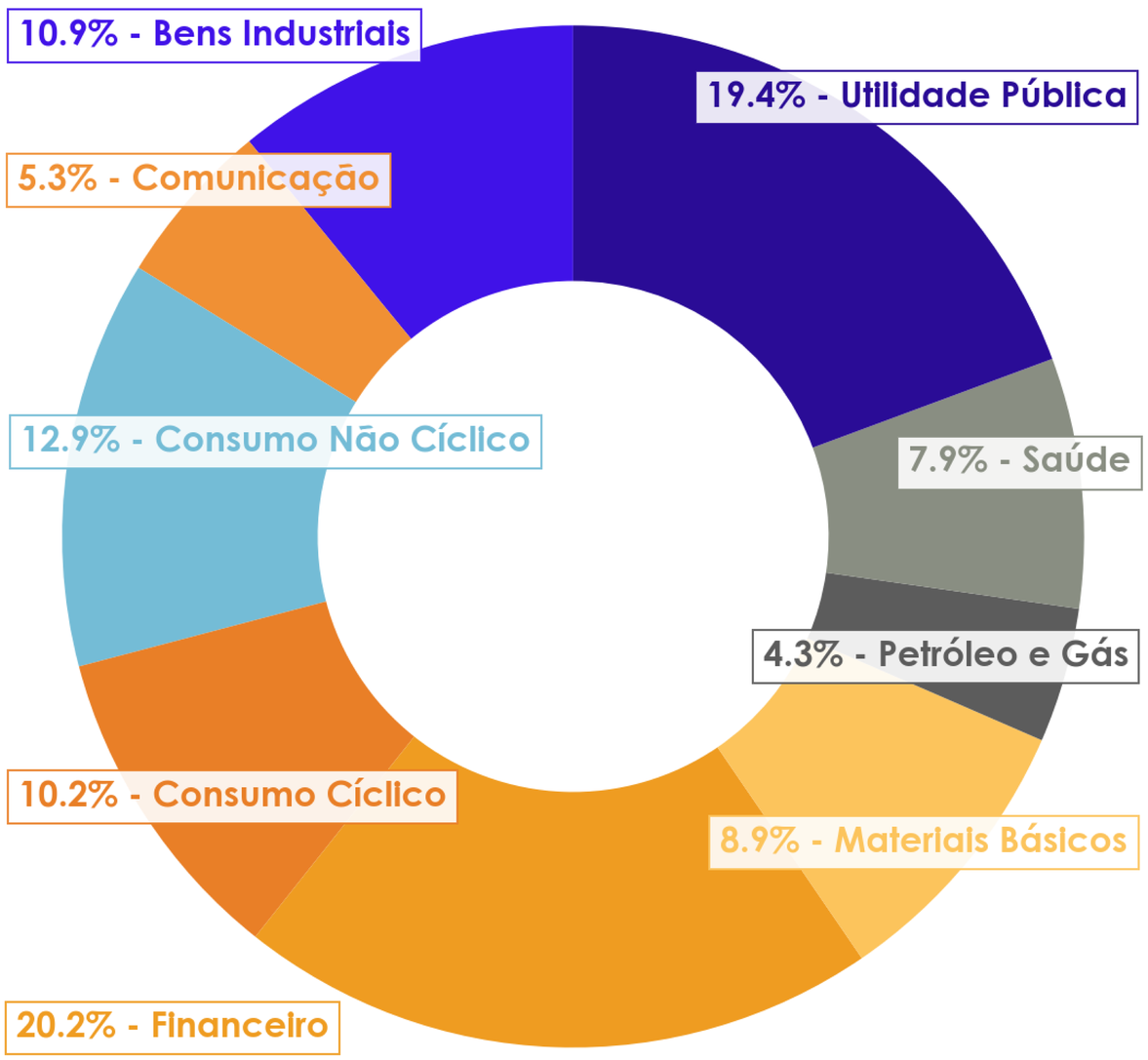


Variação Índice	Varição - Mês (%)*	Variação - Ano (%)**
IGPTW B3	31.85	8.15
IBOV	21.78	-15.90
IBRX 50	19.55	-16.48
IBRX 100	21.51	-15.60
ICO2	21.36	-16.82
IGC TRADE	25.07	-13.83
IGC - NM	52.29	-14.98
ISE	36.48	-15.82

*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

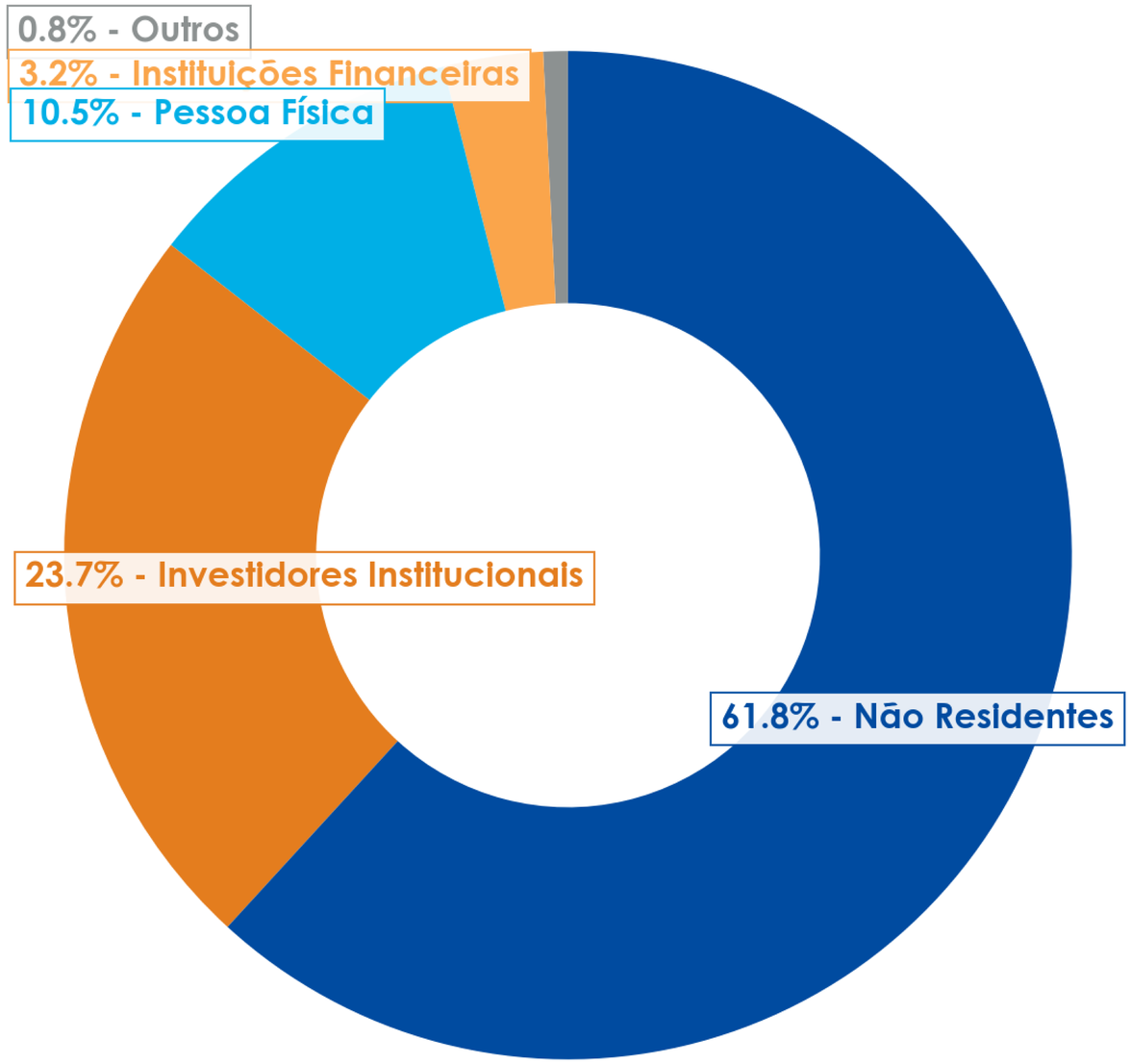


Composição ISE - TOP 15 Ativos

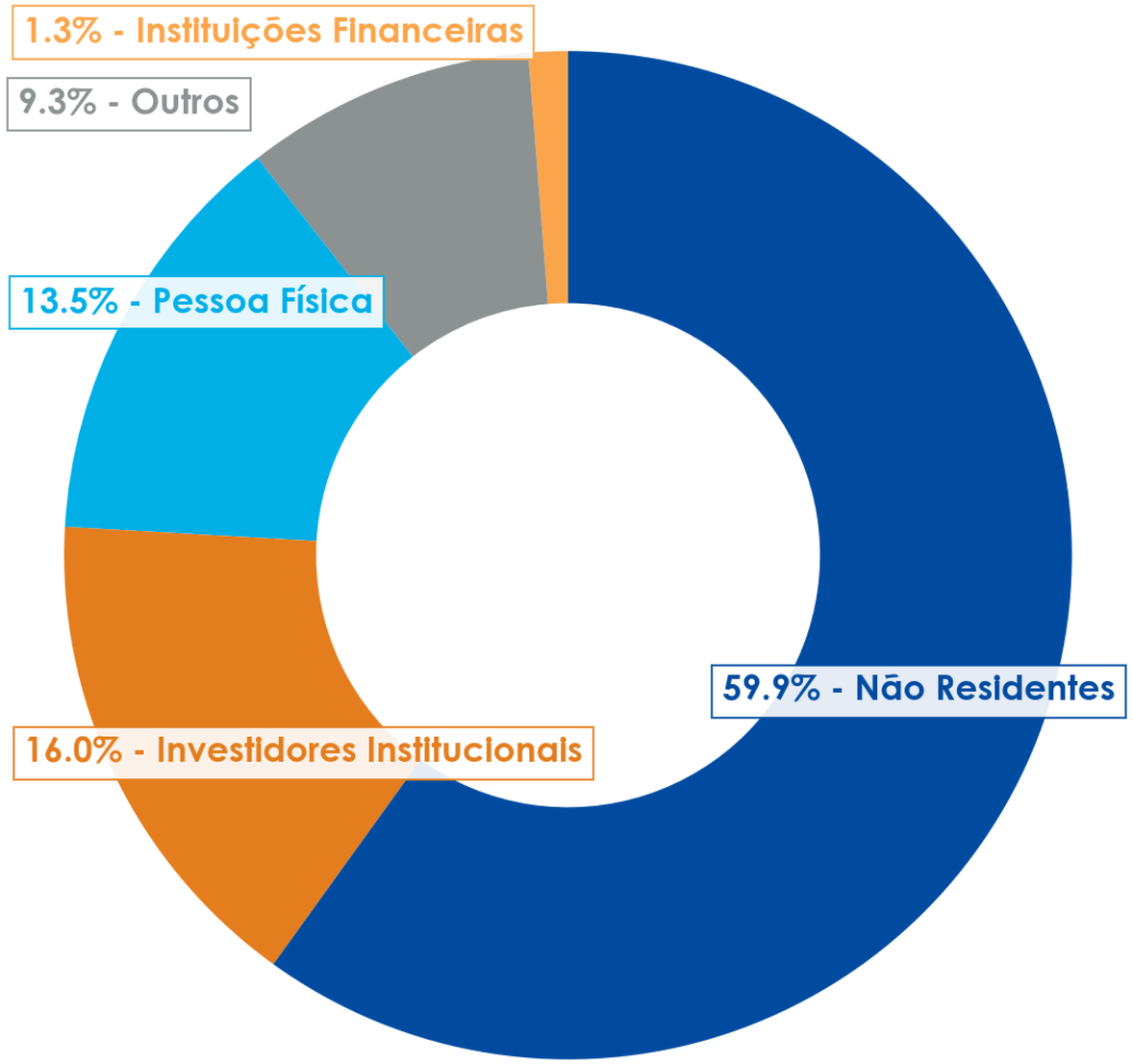
Ticker	Setor Econômico	% Mercado
VIVT3	Comunicação	2.73
KLBN11	Materiais Básicos	2.67
SUZB3	Materiais Básicos	2.62
TIMS3	Comunicação	2.52
BRFS3	Consumo Não Cíclico	2.48
CPLE6	Utilidade Pública	2.48
EGIE3	Utilidade Pública	2.44
CCRO3	Bens Industriais	2.44
BBAS3	Financeiro	2.39
ITUB4	Financeiro	2.39
ELET3	Utilidade Pública	2.38
BBDC4	Financeiro	2.37
CMIG4	Utilidade Pública	2.35
ITSA4	Financeiro	2.30
SANB11	Financeiro	2.30

Participação por Tipo Investidor*

Participação no volume negociado (R$) – September/2023



Participação na posição em custódia (R$) – September/2023



*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
VIVT3	Comunicação	5.12	13.57	43.18	22.64	106.84	2.73
KLBN11	Materiais Básicos	4.61	40.32	23.81	24.28	86.96	2.67
SUZB3	Materiais Básicos	8.24	26.39	54.28	27.69	84.91	2.62
TIMS3	Comunicação	4.54	31.04	14.89	22.68	87.30	2.52
BRFS3	Consumo Não Cíclico	12.72	-20.89	10.19	63.38	128.61	2.48
CPLE6	Utilidade Pública	3.46	42.14	8.96	35.67	152.89	2.48
EGIE3	Utilidade Pública	-1.64	17.20	41.43	19.43	115.72	2.44
CCRO3	Bens Industriais	3.45	5.53	12.89	29.12	87.92	2.44
BBAS3	Financeiro	0.88	36.88	47.18	31.13	106.39	2.39
ITUB4	Financeiro	0.24	2.76	27.21	26.72	104.74	2.39
ELET3	Utilidade Pública	4.62	-13.59	36.89	33.60	95.62	2.38
BBDC4	Financeiro	-4.23	-22.98	14.30	35.94	125.97	2.37
CMIG4	Utilidade Pública	2.15	26.83	12.41	29.71	103.23	2.35
ITSA4	Financeiro	-0.80	11.15	9.05	24.18	107.42	2.30
SANB11	Financeiro	-3.91	-8.90	26.05	27.85	97.34	2.30
NTCO3	Consumo Não Cíclico	-4.08	-1.15	14.56	53.88	82.30	2.30

*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
ENEV3	Utilidade Pública	1.17	-14.77	12.06	31.83	89.86	2.28
RADL3	Saúde	0.51	28.03	27.62	25.24	83.71	2.28
RAIL3	Bens Industriais	2.10	23.91	22.82	31.57	92.36	2.28
WEGE3	Bens Industriais	1.26	14.62	36.27	27.61	76.17	2.26
TRPL4	Utilidade Pública	-6.10	6.66	23.40	17.53	106.11	2.25
ASAI3	Consumo Não Cíclico	4.74	-30.30	12.16	43.70	130.06	2.19
BPAC11	Financeiro	-4.31	28.85	31.07	0.00	-	2.14
VBBR3	Petróleo e Gás	4.79	15.04	18.92	39.03	112.80	2.14
LREN3	Consumo Cíclico	-15.25	-49.84	13.40	50.28	118.61	2.14
CSAN3	Petróleo e Gás	-2.17	1.30	17.14	34.97	106.91	2.13
B3SA3	Financeiro	-4.14	-2.71	12.29	41.82	104.63	2.10
STBP3	Bens Industriais	-0.70	18.21	8.57	39.25	78.34	1.95
ALSO3	Financeiro	-0.79	16.77	22.59	33.69	91.87	1.94
RDOR3	Saúde	-11.34	-14.24	25.41	44.79	106.52	1.87
HYPE3	Saúde	-3.94	-13.55	37.14	27.55	94.09	1.84
CPFE3	Utilidade Pública	-1.58	8.72	33.61	27.06	100.56	1.75

*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
ABEV3	Consumo Não Cíclico	-5.27	-11.19	13.11	21.27	84.51	1.75
MGLU3	Consumo Cíclico	-23.19	-52.68	2.12	72.11	86.29	1.61
BRKM5	Materiais Básicos	-7.73	-21.80	20.52	54.29	123.41	1.47
FLRY3	Saúde	3.83	-6.33	15.15	31.20	77.23	1.43
COGN3	Consumo Cíclico	-8.90	-9.52	2.66	47.52	79.37	1.30
AZUL4	Bens Industriais	-0.07	-1.63	14.48	81.57	118.98	1.26
SAPR11	Utilidade Pública	0.93	46.59	22.86	29.96	126.63	1.24
RAIZ4	Consumo Não Cíclico	-1.38	-8.22	3.58	44.82	98.68	1.16
VAMO3	Consumo Cíclico	-16.74	-27.04	9.75	46.35	92.02	1.11
SLCE3	Consumo Não Cíclico	-2.06	7.30	39.39	26.06	65.12	1.09
ARZZ3	Consumo Cíclico	-8.08	-32.59	64.96	42.63	111.13	1.08
MRVE3	Consumo Cíclico	-6.07	-14.09	10.67	53.56	96.98	1.06
CIEL3	Financeiro	-5.65	-31.04	3.51	37.83	72.88	1.04
NEOE3	Utilidade Pública	0.93	28.97	18.41	27.43	105.14	0.99
AESB3	Utilidade Pública	-1.18	15.83	10.91	23.66	91.92	0.95
USIM5	Materiais Básicos	-3.49	-7.43	6.64	37.35	79.38	0.93

*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
BPAN4	Financeiro	-7.66	20.60	8.08	43.77	69.48	0.73
ECOR3	Bens Industriais	2.52	56.03	7.74	47.92	105.16	0.69
MDIA3	Consumo Não Cíclico	-1.67	-16.17	36.53	41.07	96.07	0.64
DXCO3	Materiais Básicos	-3.27	-5.20	7.70	46.86	111.25	0.64
BEEF3	Consumo Não Cíclico	-3.69	-31.59	8.09	46.04	119.15	0.58
MRFG3	Consumo Não Cíclico	-3.78	-17.84	7.13	45.21	105.09	0.57
SIMH3	Financeiro	-9.33	-6.26	8.84	50.22	102.80	0.54
DASA3	Saúde	12.25	-33.95	12.37	69.00	145.75	0.50
MYPK3	Consumo Cíclico	-1.37	12.42	13.70	37.94	96.10	0.50
GRND3	Consumo Cíclico	-1.62	14.56	6.70	33.36	88.65	0.48
MOVI3	Consumo Cíclico	-4.27	0.49	11.88	61.90	140.65	0.38
BHIA3	Consumo Cíclico	-50.39	-80.25	0.63	72.22	-	0.38
RANI3	Materiais Básicos	15.39	76.33	12.67	32.78	78.08	0.36
AMBP3	Utilidade Pública	-1.15	-23.89	20.67	51.37	92.24	0.25
CBAV3	Materiais Básicos	6.78	-56.92	4.57	55.79	91.35	0.23
PCAR3	Consumo Não Cíclico	-29.15	-56.42	3.50	54.36	120.43	0.15

*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
GUAR3	Consumo Cíclico	-15.52	-39.59	5.28	68.54	117.62	0.12
GFSA3	Consumo Cíclico	-17.37	-47.19	4.14	122.64	191.74	0.07
AERI3	Bens Industriais	-12.63	-58.71	0.83	76.17	121.58	0.05

*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