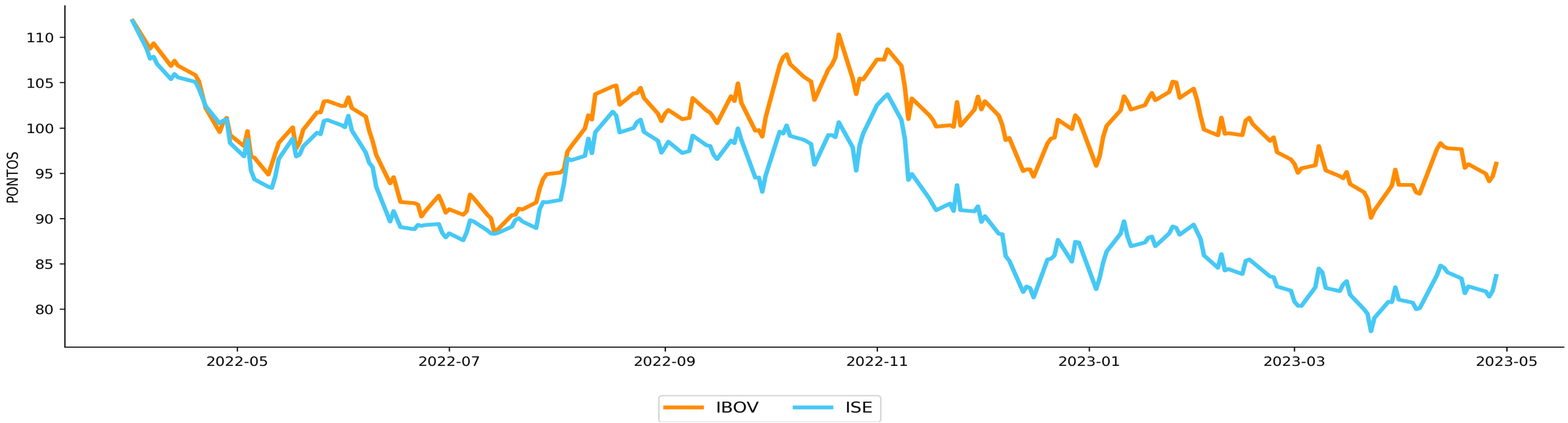
Boletim Mensal de ISE

April/2023

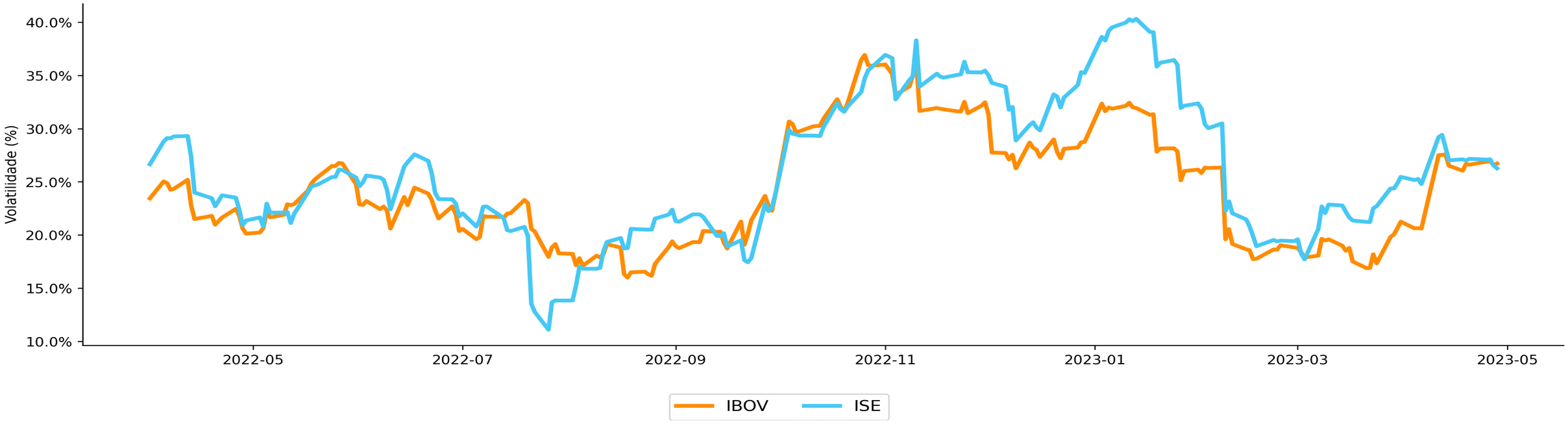
Comparativo ISE e Outros Indicadores



Indice	Variação MoM (%)	Variação YTD (%)	Variação 12M (%)	Variação Total (%)*
IGPTW B3	2.65	-5.31	-17.74	-16.99
IBOV	2.50	0.26	-3.19	-3.94
IBRX 50	1.64	-1.59	-4.09	-2.63
IBRX 100	1.93	-0.67	-4.80	-3.28
ICO2	4.01	3.67	-7.08	-22.71
IGC TRADE	2.20	-0.41	-4.94	-2.86
IGC - NM	0.58	-2.12	-9.19	-8.33
ISE	3.23	1.78	-14.91	-16.34

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

Volatilidade ISE e Outros Indicadores

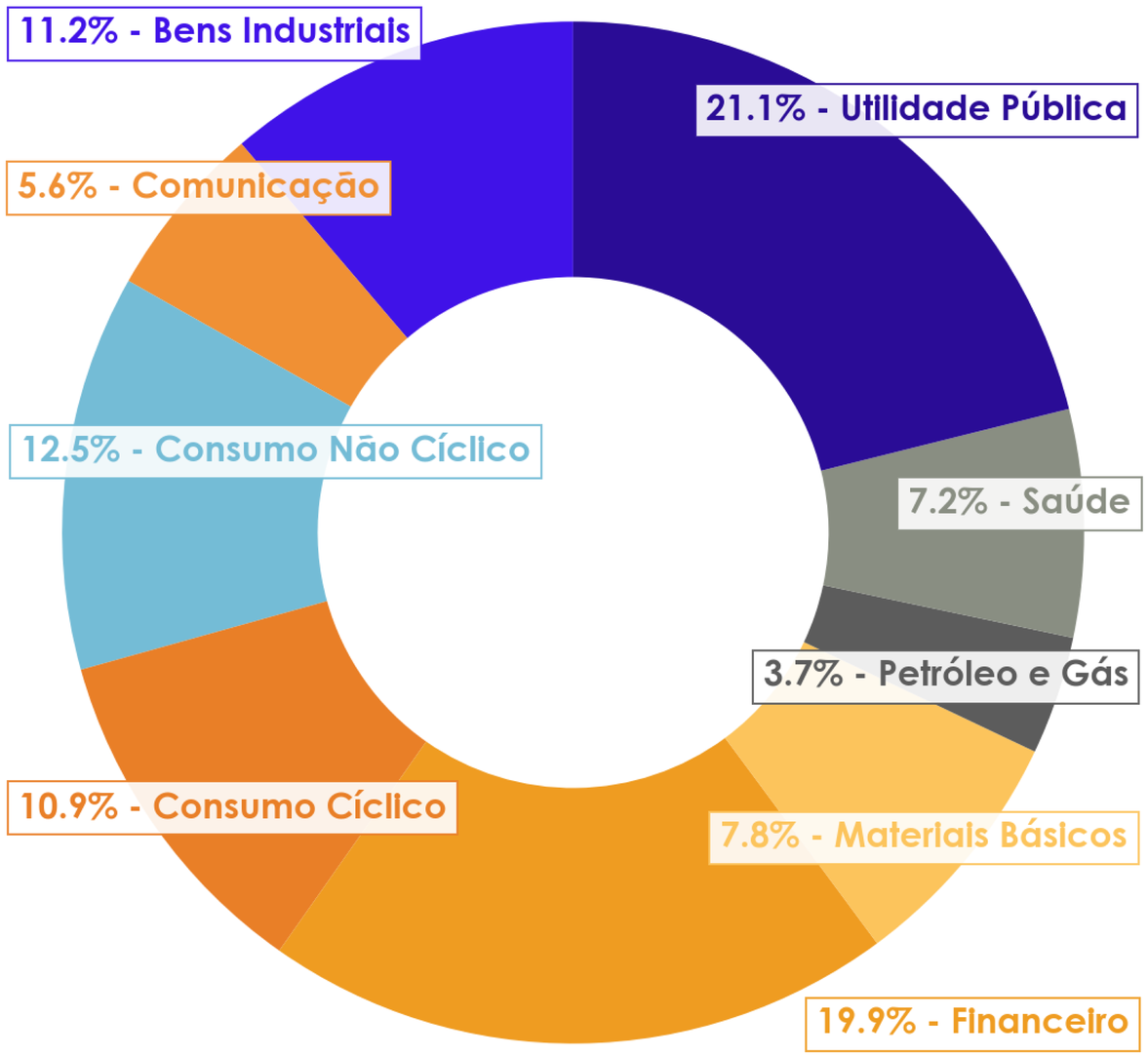


Variação Índice	Varição - Mês (%)*	Variação - Ano (%)**
IGPTW B3	7.82	37.76
IBOV	25.71	32.74
IBRX 50	32.03	27.57
IBRX 100	29.78	31.86
ICO2	5.75	24.30
IGC TRADE	30.03	30.88
IGC - NM	27.24	24.77
ISE	3.16	22.95

*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

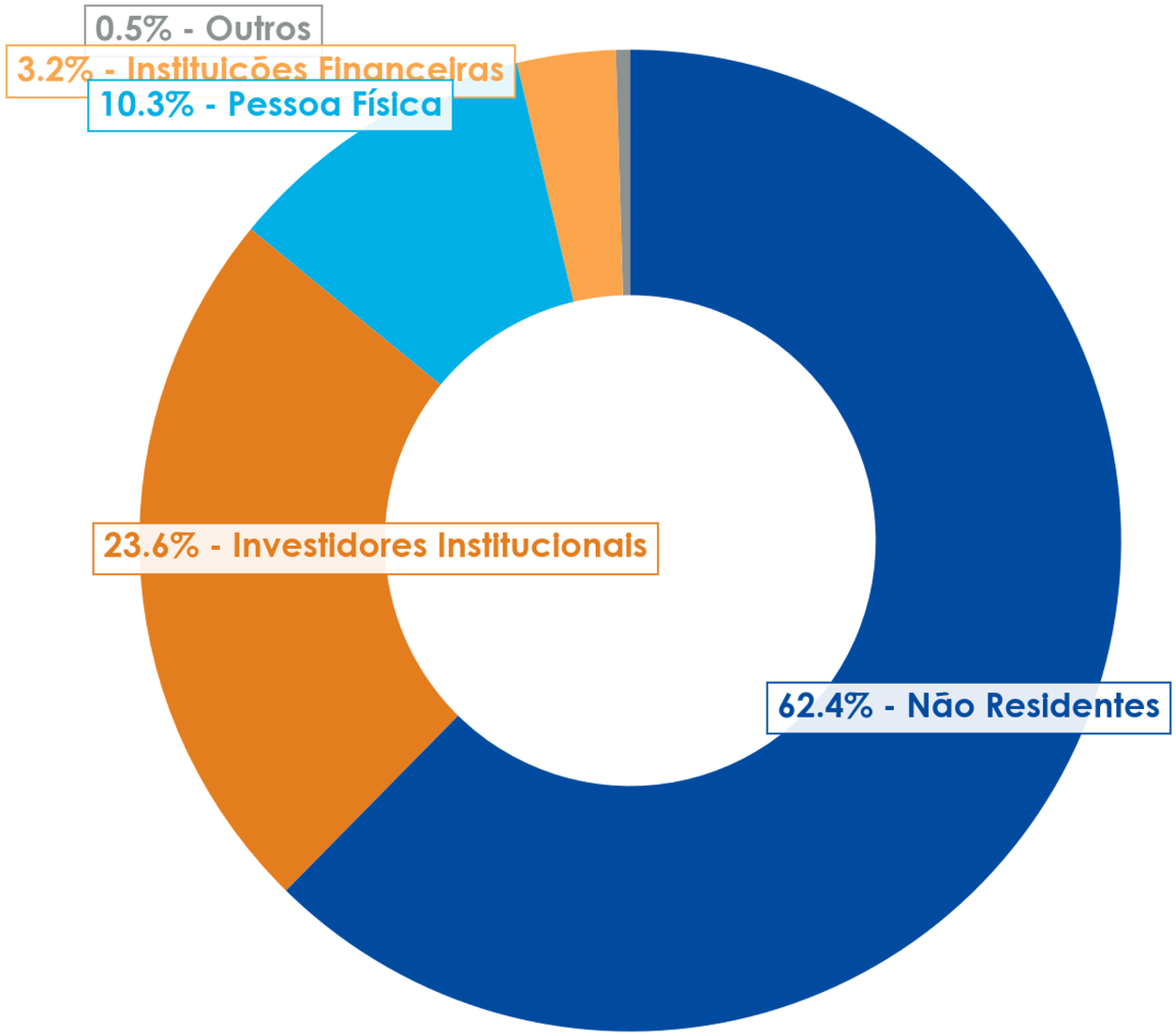


Composição ISE - TOP 15 Ativos

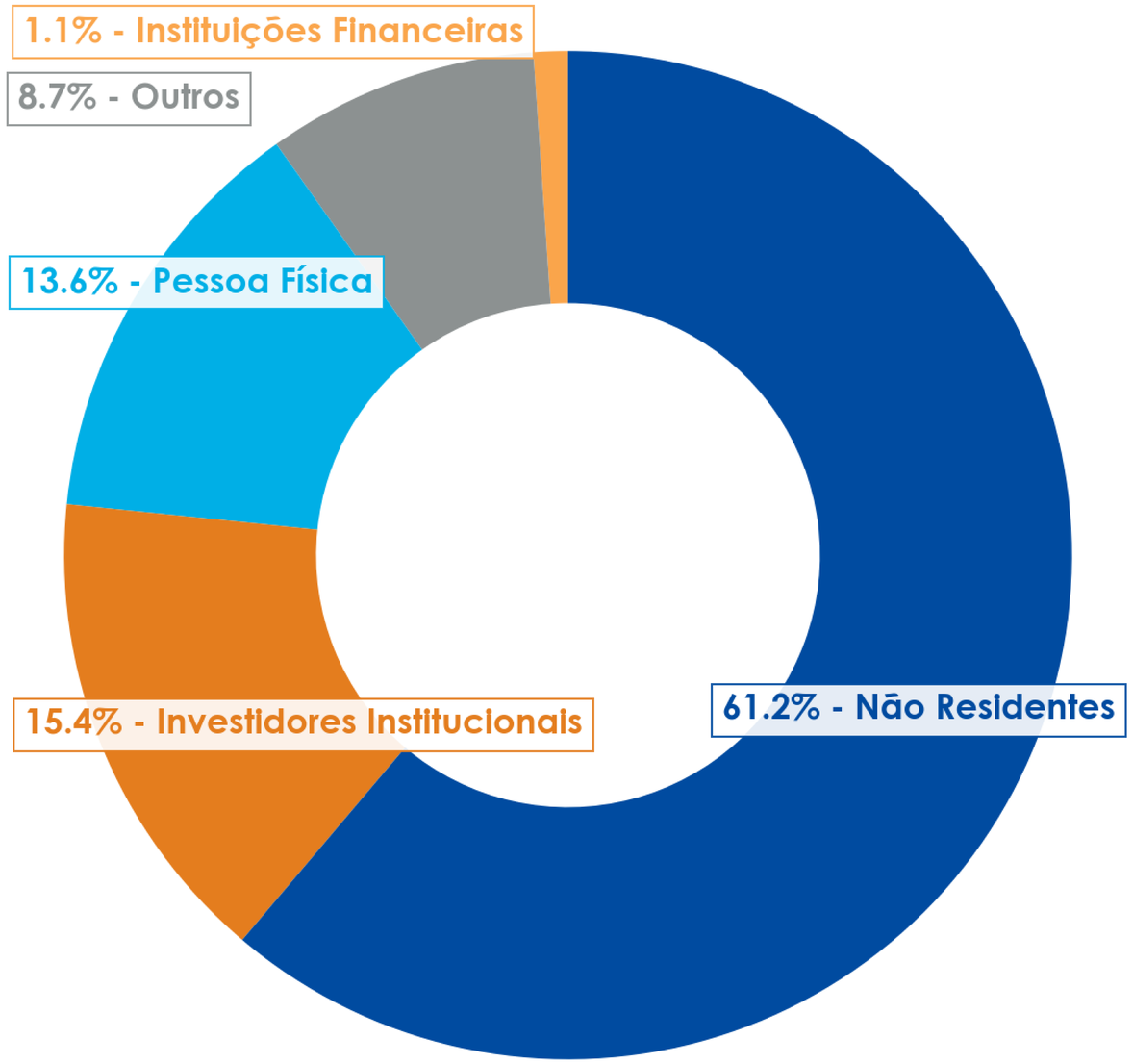
Ticker	Setor Econômico	% Mercado
CCRO3	Bens Industriais	2.97
BBAS3	Financeiro	2.90
VIVT3	Comunicação	2.82
TIMS3	Comunicação	2.74
MGLU3	Consumo Cíclico	2.69
CMIG4	Utilidade Pública	2.68
EGIE3	Utilidade Pública	2.62
CPLE6	Utilidade Pública	2.48
RADL3	Saúde	2.46
ITUB4	Financeiro	2.45
ITSA4	Financeiro	2.38
KLBN11	Materiais Básicos	2.35
RAIL3	Bens Industriais	2.35
TRPL4	Utilidade Pública	2.32
BPAC11	Financeiro	2.32

Participação por Tipo Investidor*

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



Participação na posição em custódia (R$) – April/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
CCRO3	Bens Industriais	6.32	12.18	13.57	32.61	95.21	2.97
BBAS3	Financeiro	9.59	44.50	42.86	33.28	119.45	2.90
VIVT3	Comunicação	8.16	-18.09	41.12	23.18	111.82	2.82
TIMS3	Comunicação	14.23	11.06	14.00	24.09	91.42	2.74
MGLU3	Consumo Cíclico	0.91	-31.56	3.34	83.04	126.62	2.69
CMIG4	Utilidade Pública	8.94	25.91	12.35	32.40	114.93	2.68
EGIE3	Utilidade Pública	2.64	3.84	41.23	20.26	121.32	2.62
CPLE6	Utilidade Pública	15.56	20.95	8.02	35.78	138.74	2.48
RADL3	Saúde	7.90	27.25	26.28	29.51	96.69	2.46
ITUB4	Financeiro	4.84	14.23	25.92	27.48	101.74	2.45
ITSA4	Financeiro	5.60	9.54	8.68	25.06	104.50	2.38
KLBN11	Materiais Básicos	5.75	-0.90	19.13	26.97	100.56	2.35
RAIL3	Bens Industriais	4.87	20.75	19.70	33.00	97.00	2.35
TRPL4	Utilidade Pública	6.37	-4.08	23.05	19.01	104.57	2.32
BPAC11	Financeiro	19.19	4.42	23.42	0.00	-	2.32
WEGE3	Bens Industriais	1.41	38.91	41.12	32.05	92.26	2.31

*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
NTCO3	Consumo Não Cíclico	-16.21	-40.51	11.06	63.36	120.09	2.30
BBDC4	Financeiro	5.32	-17.90	13.85	34.83	115.06	2.27
SANB11	Financeiro	1.80	-10.08	26.87	28.28	92.93	2.25
ENEV3	Utilidade Pública	8.40	-17.27	11.35	33.54	96.77	2.13
ABEV3	Consumo Não Cíclico	-1.19	2.66	14.16	23.70	81.64	2.00
STBP3	Bens Industriais	4.62	29.17	8.46	44.82	91.92	1.99
B3SA3	Financeiro	12.85	-9.17	11.68	44.81	115.10	1.95
CSAN3	Petróleo e Gás	-0.73	-27.04	14.98	37.55	123.11	1.93
SUZB3	Materiais Básicos	-4.33	-15.91	39.80	30.78	97.71	1.91
ELET3	Utilidade Pública	2.38	-15.83	33.85	32.15	81.91	1.88
LREN3	Consumo Cíclico	-4.41	-31.08	15.84	46.17	119.27	1.86
CPFE3	Utilidade Pública	4.71	0.71	33.14	30.69	123.65	1.82
VBBR3	Petróleo e Gás	-8.40	-34.69	13.20	37.87	113.89	1.81
BRFS3	Consumo Não Cíclico	2.09	-53.31	6.34	61.41	138.72	1.80
CIEL3	Financeiro	12.58	69.16	5.46	42.46	83.71	1.69
ASAI3	Consumo Não Cíclico	-20.59	-19.09	12.29	35.09	108.54	1.66

*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
ENBR3	Utilidade Pública	1.95	13.94	22.50	25.89	129.58	1.62
HYPE3	Saúde	-1.19	2.52	37.25	31.27	114.46	1.57
RDOR3	Saúde	7.67	-37.10	22.87	49.73	138.76	1.55
FLRY3	Saúde	0.00	3.63	14.52	37.99	112.86	1.47
BRKM5	Materiais Básicos	2.22	-50.80	19.79	47.86	99.81	1.47
SLCE3	Consumo Não Cíclico	-4.58	-13.18	43.50	33.54	82.09	1.21
VAMO3	Consumo Cíclico	-8.46	-8.62	12.22	47.15	96.94	1.14
ARZZ3	Consumo Cíclico	4.52	-23.98	66.38	40.39	111.54	1.13
SAPR11	Utilidade Pública	4.91	4.29	19.00	29.88	121.41	1.11
RAIZ4	Consumo Não Cíclico	11.93	-50.62	3.19	50.24	122.15	1.10
USIM5	Materiais Básicos	3.55	-33.26	7.20	45.37	96.12	1.07
COGN3	Consumo Cíclico	9.09	-16.73	2.04	51.35	90.84	1.07
AZUL4	Bens Industriais	-9.73	-50.57	10.86	83.61	141.07	0.98
AESB3	Utilidade Pública	7.44	-1.80	10.68	22.59	72.50	0.97
NEOE3	Utilidade Pública	6.89	-12.27	15.45	26.88	111.44	0.92
VIIA3	Consumo Cíclico	-2.13	-38.05	1.84	75.95	118.52	0.82

*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
PCAR3	Consumo Não Cíclico	1.83	-26.22	15.00	48.84	116.51	0.67
ALSO3	Financeiro	5.91	-9.96	18.64	35.48	95.35	0.65
BEEF3	Consumo Não Cíclico	-15.58	-31.19	8.55	42.75	105.92	0.64
MRVE3	Consumo Cíclico	12.85	-27.36	7.20	57.92	131.10	0.63
GRND3	Consumo Cíclico	13.63	-10.35	8.17	36.48	95.42	0.63
MRFG3	Consumo Não Cíclico	-1.96	-58.72	6.51	46.49	119.48	0.58
MDIA3	Consumo Não Cíclico	13.40	21.56	28.60	47.67	143.11	0.56
ECOR3	Bens Industriais	19.11	-10.54	6.17	52.21	134.60	0.54
BPAN4	Financeiro	5.10	-40.15	5.36	48.12	73.19	0.52
SIMH3	Financeiro	2.54	-29.60	7.67	50.90	107.95	0.51
DXCO3	Materiais Básicos	0.17	-47.32	5.89	47.63	122.51	0.46
MYPK3	Consumo Cíclico	-5.42	-9.92	11.35	40.46	96.47	0.43
MOVI3	Consumo Cíclico	6.43	-47.89	8.61	58.60	139.29	0.33
LIGT3	Utilidade Pública	31.97	-63.94	3.22	76.82	165.81	0.30
CBAV3	Materiais Básicos	-25.45	-66.21	5.28	59.73	100.93	0.30
AMBP3	Utilidade Pública	-3.39	-41.14	20.50	53.96	95.74	0.26

*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
RANI3	Materiais Básicos	5.35	48.01	8.68	35.40	78.91	0.25
DASA3	Saúde	13.12	-62.53	8.45	58.87	137.74	0.15
GUAR3	Consumo Cíclico	-1.63	-53.62	4.23	65.52	130.99	0.10
AERI3	Bens Industriais	33.05	-67.83	1.57	85.56	165.88	0.10
GFSA3	Consumo Cíclico	-4.34	-58.26	5.73	120.75	239.35	0.10

*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