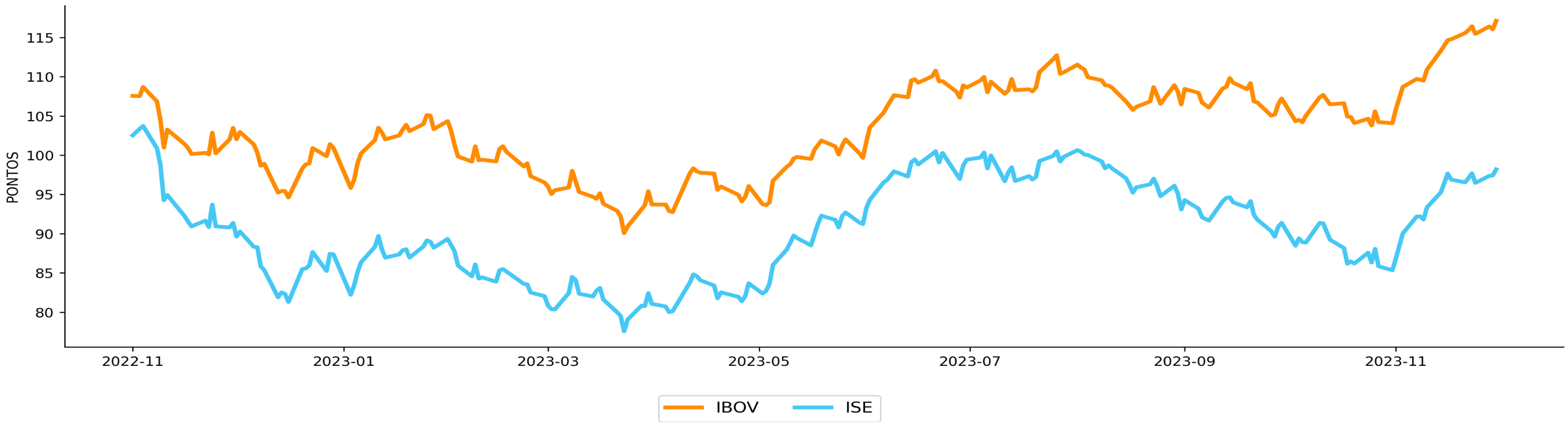
Boletim Mensal de ISE

November/2023

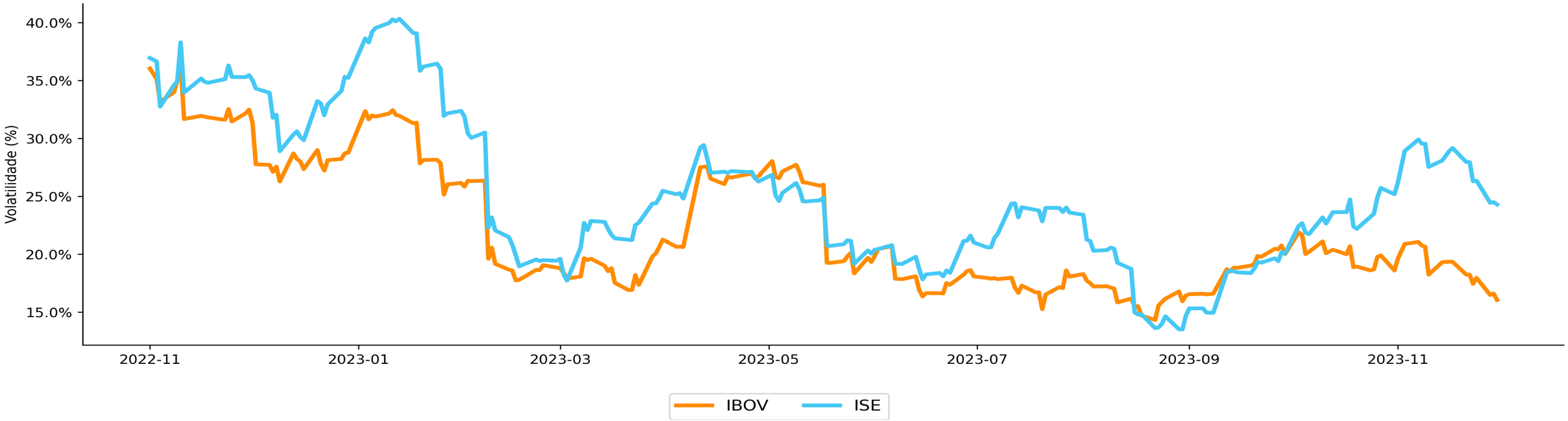
Comparativo ISE e Outros Indicadores



Indice	Variação MoM (%)	Variação YTD (%)	Variação 12M (%)	Variação Total (%)*
IGPTW B3	13.46	6.22	-2.05	-6.88
IBOV	12.54	22.24	13.20	17.12
IBRX 50	12.01	19.68	11.10	18.41
IBRX 100	12.38	20.82	11.95	17.65
ICO2	14.88	25.65	13.73	-6.32
IGC TRADE	12.28	21.73	12.70	18.74
IGC - NM	12.77	14.70	7.57	7.43
ISE	15.06	19.44	7.48	-1.82

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

Volatilidade ISE e Outros Indicadores

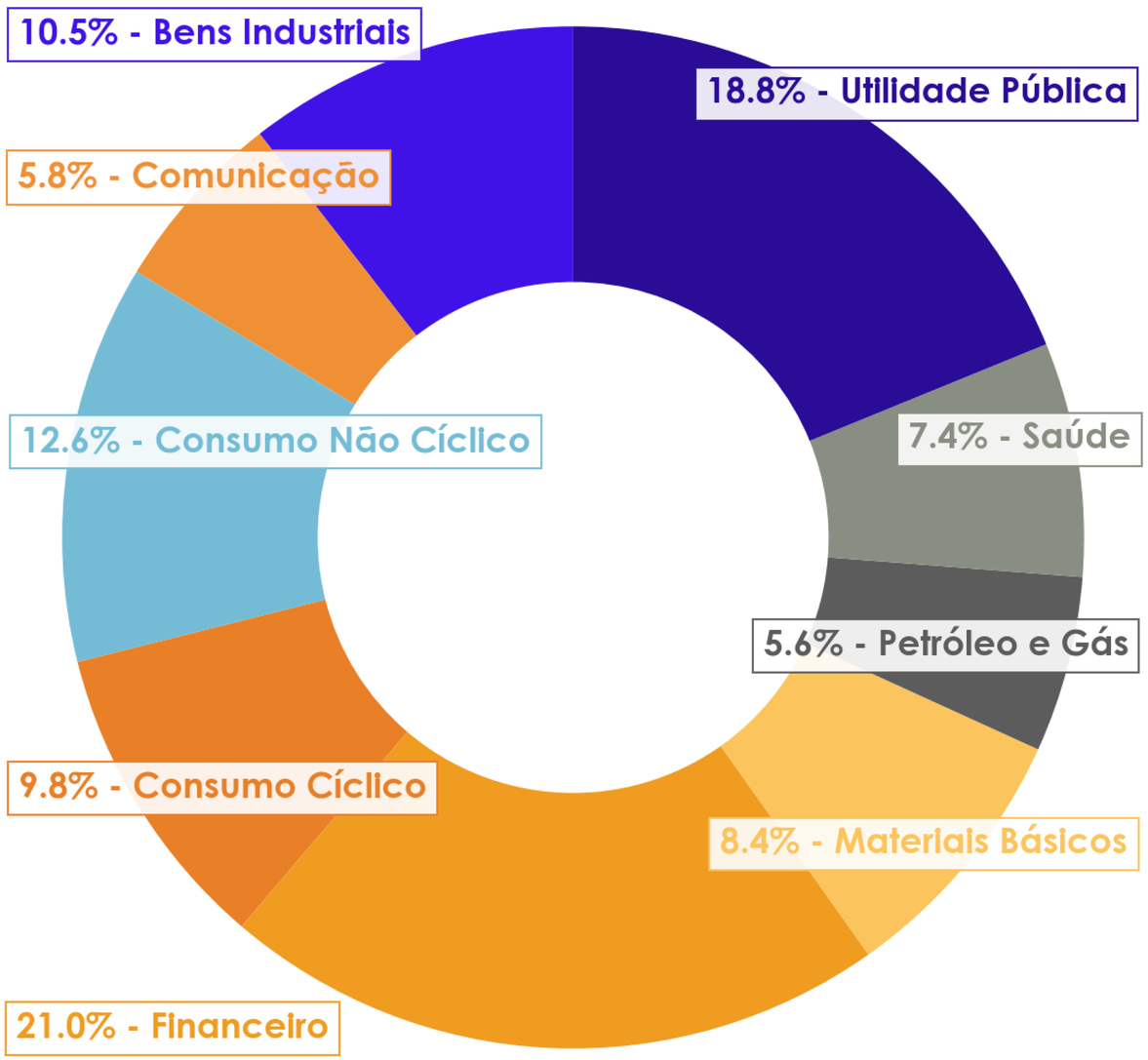


Variação Índice	Varição - Mês (%)*	Variação - Ano (%)**
IGPTW B3	-18.48	-30.22
IBOV	-13.72	-50.63
IBRX 50	-14.17	-53.04
IBRX 100	-13.43	-51.09
ICO2	-2.05	-42.27
IGC TRADE	-14.39	-50.52
IGC - NM	-17.04	-41.90
ISE	-3.53	-31.52

*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

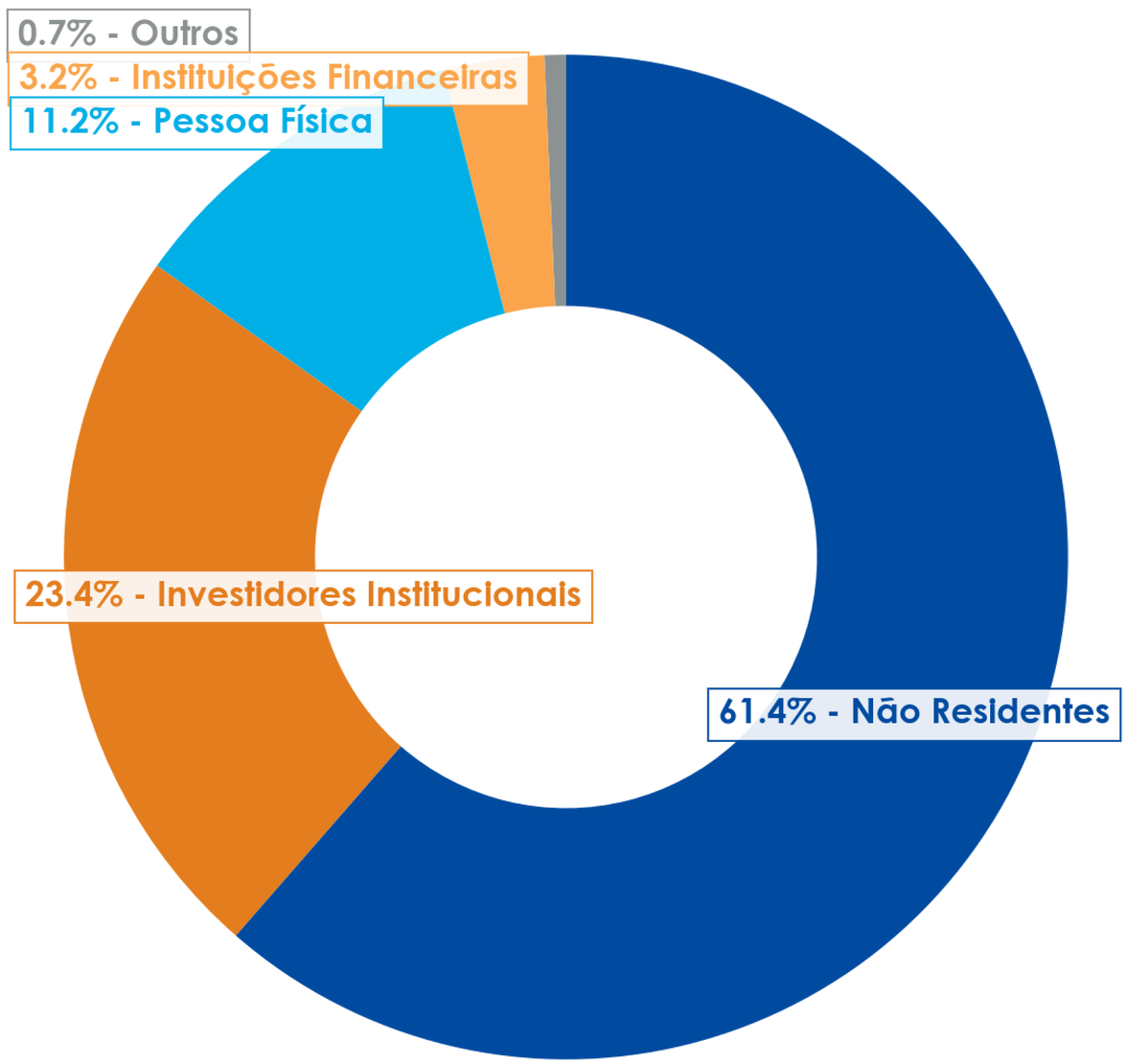


Composição ISE - TOP 15 Ativos

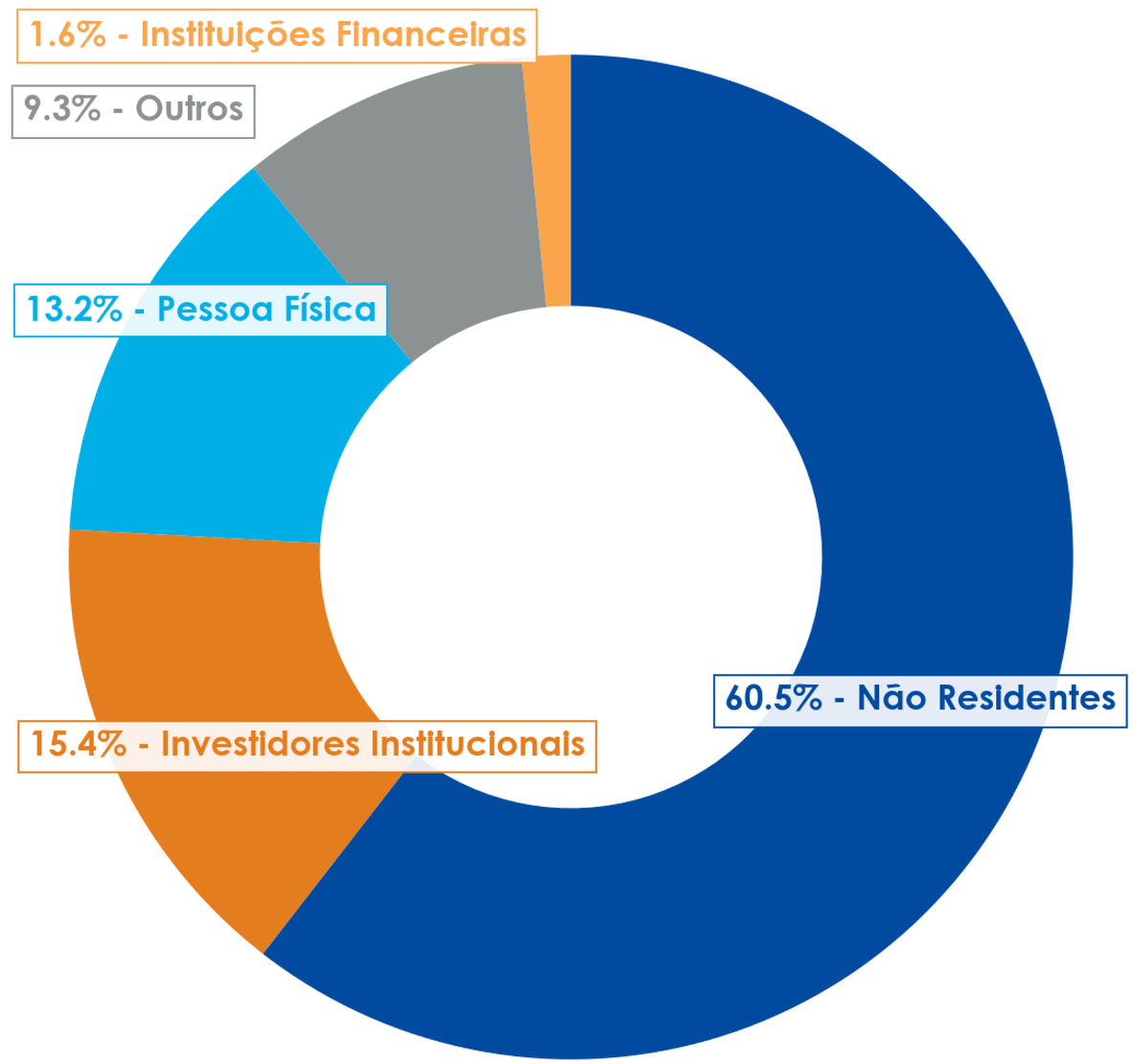
Ticker	Setor Econômico	% Mercado
BRFS3	Consumo Não Cíclico	3.45
VIVT3	Comunicação	3.10
TIMS3	Comunicação	2.69
ITUB4	Financeiro	2.54
SANB11	Financeiro	2.54
BBDC4	Financeiro	2.50
ELET3	Utilidade Pública	2.49
KLBN11	Materiais Básicos	2.48
BBAS3	Financeiro	2.47
SUZB3	Materiais Básicos	2.46
CPLE6	Utilidade Pública	2.44
VBBR3	Petróleo e Gás	2.40
LREN3	Consumo Cíclico	2.39
ITSA4	Financeiro	2.39
EGIE3	Utilidade Pública	2.39

Participação por Tipo Investidor*

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



Participação na posição em custódia (R$) – November/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
BRFS3	Consumo Não Cíclico	37.39	55.63	14.66	63.13	120.02	3.45
VIVT3	Comunicação	16.62	47.97	52.76	22.24	112.72	3.10
TIMS3	Comunicação	13.65	40.98	17.24	21.70	88.86	2.69
ITUB4	Financeiro	17.86	28.76	31.59	24.33	92.65	2.54
SANB11	Financeiro	15.16	18.99	31.00	25.77	89.26	2.54
BBDC4	Financeiro	16.45	11.69	16.27	30.50	95.82	2.50
ELET3	Utilidade Pública	17.28	-13.42	40.86	30.72	87.75	2.49
KLBN11	Materiais Básicos	5.47	21.56	22.57	22.39	80.39	2.48
BBAS3	Financeiro	14.00	70.60	54.27	25.84	81.10	2.47
SUZB3	Materiais Básicos	4.29	4.84	53.78	26.64	84.17	2.46
CPLE6	Utilidade Pública	12.75	21.62	9.46	24.39	70.72	2.44
VBBR3	Petróleo e Gás	17.99	48.16	23.35	35.59	96.90	2.40
LREN3	Consumo Cíclico	33.52	-26.28	16.37	49.53	113.94	2.39
ITSA4	Financeiro	18.49	25.25	9.75	22.05	93.04	2.39
EGIE3	Utilidade Pública	10.69	18.24	43.50	17.36	91.27	2.39
CCRO3	Bens Industriais	13.02	16.48	13.54	27.52	83.07	2.38

*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	29.33	40.82	16.49	52.73	81.52	2.33
BPAC11	Financeiro	20.07	45.28	35.54	0.00	-	2.26
ASAI3	Consumo Não Cíclico	18.19	-35.12	12.93	43.90	121.84	2.21
RADL3	Saúde	8.84	27.98	28.08	23.45	74.85	2.20
ENEV3	Utilidade Pública	17.28	2.84	12.69	32.30	91.42	2.18
TRPL4	Utilidade Pública	13.92	9.61	24.14	19.80	108.55	2.17
RAIL3	Bens Industriais	2.64	18.08	22.90	28.41	79.54	2.14
B3SA3	Financeiro	19.82	7.93	13.30	37.85	88.43	2.13
CSAN3	Petróleo e Gás	12.70	1.12	17.75	31.38	86.95	2.06
ALOS3	Financeiro	11.70	46.92	25.58	30.73	-	2.03
WEGE3	Bens Industriais	3.57	-10.96	34.19	25.65	68.07	1.98
CMIG4	Utilidade Pública	-5.71	6.04	11.07	26.60	81.00	1.91
RDOR3	Saúde	23.03	-13.41	26.60	44.61	101.97	1.82
STBP3	Bens Industriais	13.78	15.66	8.42	36.55	75.99	1.79
CPFE3	Utilidade Pública	10.80	15.93	37.05	24.40	86.40	1.74
ABEV3	Consumo Não Cíclico	6.45	-9.48	13.69	20.53	84.45	1.67

*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
HYPE3	Saúde	11.52	-21.70	33.78	28.53	96.03	1.56
FLRY3	Saúde	14.54	4.82	17.17	30.07	75.25	1.49
AZUL4	Bens Industriais	31.13	37.54	16.89	79.66	115.10	1.46
COGN3	Consumo Cíclico	34.58	44.20	3.23	47.30	83.11	1.45
BRKM5	Materiais Básicos	19.04	-32.02	19.13	50.19	101.85	1.38
MGLU3	Consumo Cíclico	51.88	-40.76	2.02	77.32	92.91	1.37
SAPR11	Utilidade Pública	20.60	50.32	26.23	24.59	83.61	1.31
RAIZ4	Petróleo e Gás	0.55	-3.25	3.65	43.47	95.62	1.11
CIEL3	Financeiro	16.40	-10.23	4.02	36.58	73.94	1.04
USIM5	Materiais Básicos	18.91	5.38	7.86	32.39	69.24	1.02
VAMO3	Consumo Cíclico	17.88	-28.79	9.23	48.88	98.93	1.00
SLCE3	Consumo Não Cíclico	2.50	-1.00	37.68	25.77	66.85	0.98
ARZZ3	Consumo Cíclico	3.53	-31.08	59.34	42.78	114.20	0.95
NEOE3	Utilidade Pública	10.56	30.83	19.37	26.39	96.24	0.95
MRVE3	Consumo Cíclico	17.21	12.57	9.67	54.38	96.76	0.93
AESB3	Utilidade Pública	7.94	4.03	10.87	21.81	84.67	0.88

*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
MRFG3	Consumo Não Cíclico	50.46	26.34	9.72	44.98	98.36	0.78
ECOR3	Bens Industriais	24.49	100.83	8.65	45.11	96.57	0.72
BPAN4	Financeiro	13.09	15.36	7.95	41.10	71.23	0.65
MDIA3	Consumo Não Cíclico	8.25	-9.65	35.28	41.76	94.37	0.59
DXCO3	Materiais Básicos	5.83	0.09	7.26	45.68	103.23	0.56
SIMH3	Financeiro	22.54	13.84	8.48	48.81	98.85	0.49
BEEF3	Consumo Não Cíclico	-4.10	-38.41	7.26	43.47	103.82	0.48
GRND3	Consumo Cíclico	7.21	19.53	6.59	31.44	85.67	0.45
MYPK3	Consumo Cíclico	5.94	-7.04	11.95	35.09	86.20	0.40
AMBP3	Utilidade Pública	9.30	-35.83	14.92	50.17	94.06	0.37
MOVI3	Consumo Cíclico	27.20	29.83	11.13	58.76	123.19	0.35
DASA3	Saúde	-5.16	-39.87	9.19	70.88	148.53	0.33
BHIA3	Consumo Cíclico	20.00	-75.23	0.54	74.99	-	0.32
RANI3	Materiais Básicos	-4.21	29.63	10.28	31.43	80.45	0.27
CBAV3	Materiais Básicos	9.07	-63.06	4.14	52.45	85.38	0.22
PCAR3	Consumo Não Cíclico	-7.46	-61.06	3.35	55.35	124.55	0.14

*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	29.18	-16.98	6.11	71.34	121.66	0.13
GFSA3	Consumo Cíclico	26.20	5.99	6.55	128.84	198.18	0.10
AERI3	Bens Industriais	2.35	-39.58	0.87	75.13	115.44	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