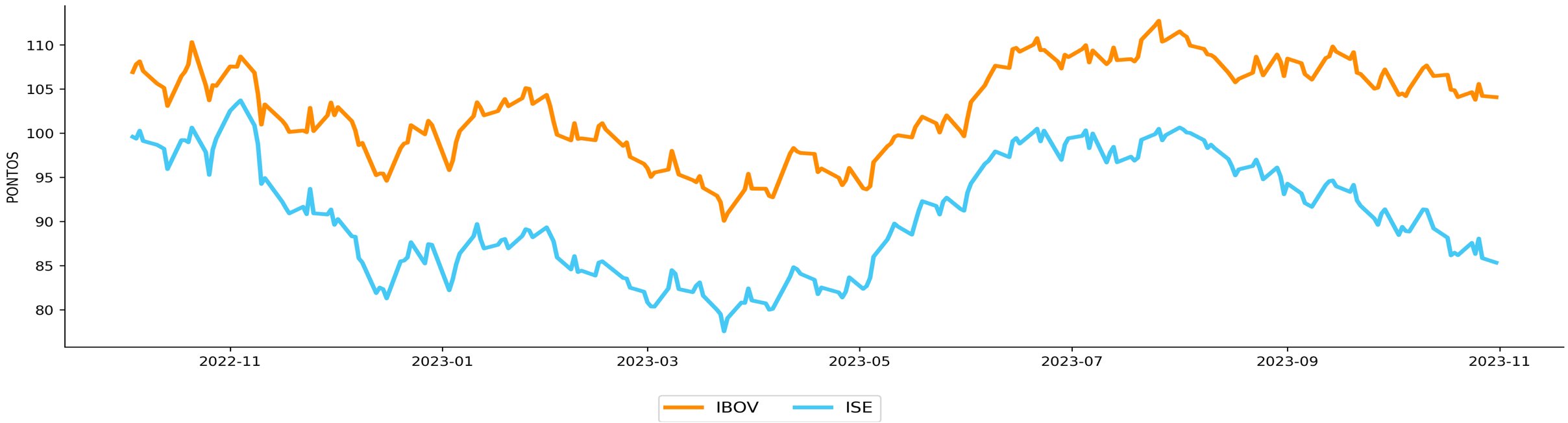
Boletim Mensal de ISE

October/2023

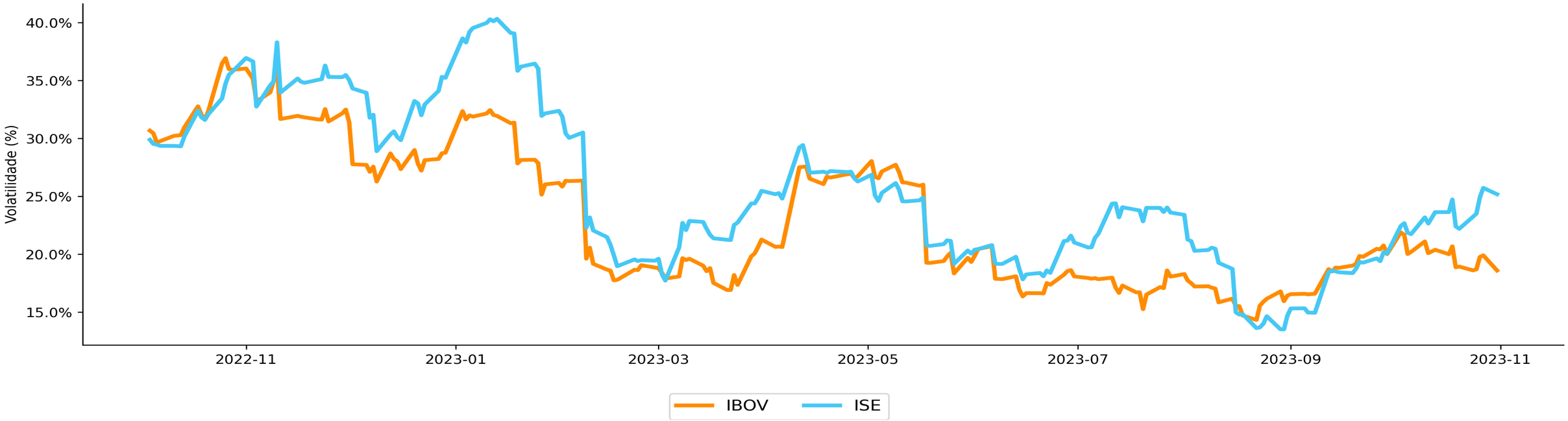
Comparativo ISE e Outros Indicadores



Indice	Variação MoM (%)	Variação YTD (%)	Variação 12M (%)	Variação Total (%)*
IGPTW B3	-8.48	-6.38	-21.64	-17.93
IBOV	-2.94	8.62	-1.22	4.07
IBRX 50	-2.99	6.85	-2.11	5.71
IBRX 100	-3.03	7.51	-2.28	4.70
ICO2	-4.30	9.37	-7.78	-18.46
IGC TRADE	-3.51	8.41	-2.05	5.74
IGC - NM	-4.35	1.71	-5.24	-4.74
ISE	-6.61	3.81	-14.14	-14.67

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

Volatilidade ISE e Outros Indicadores

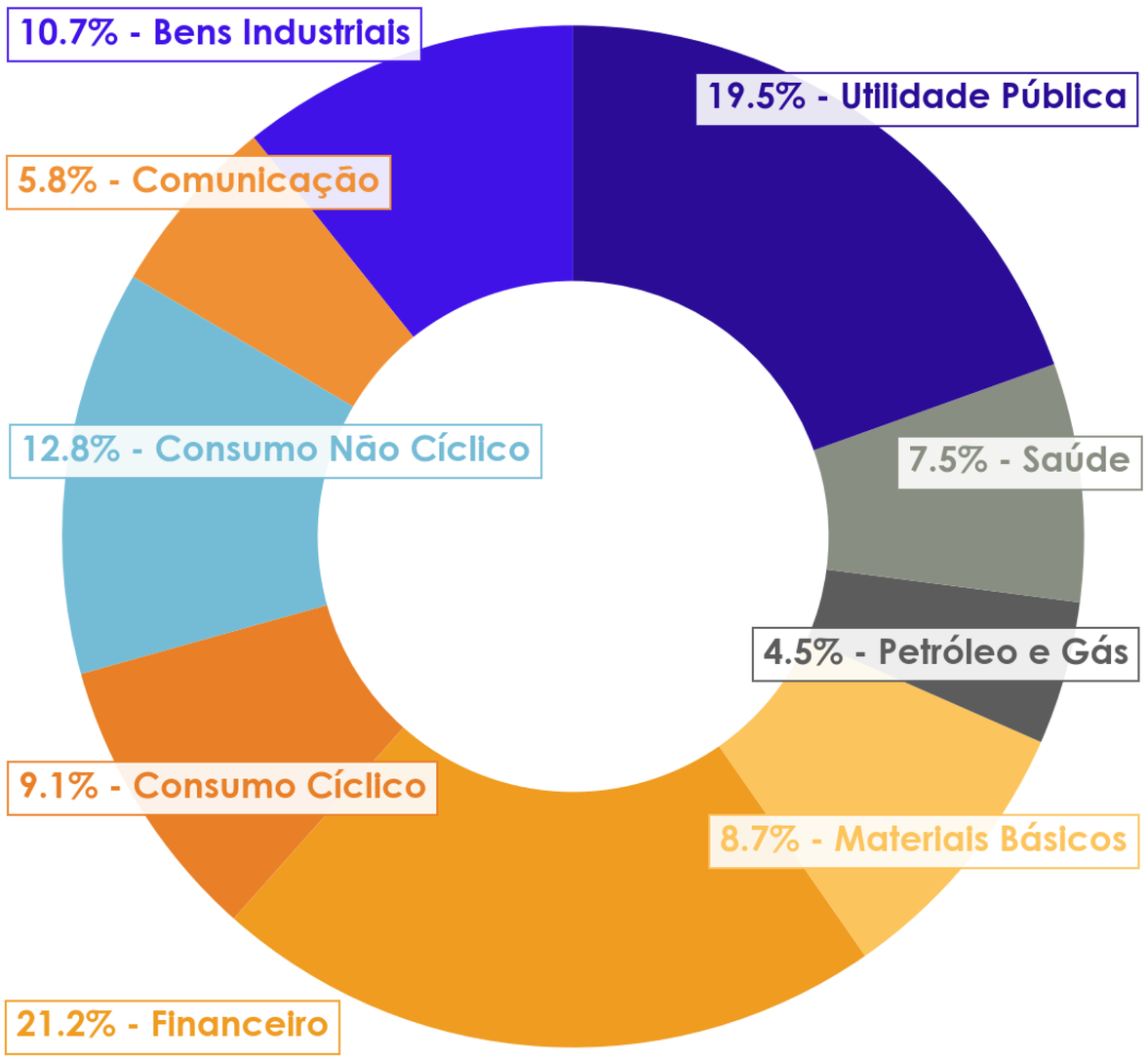


Variação Índice	Varição - Mês (%)*	Variação - Ano (%)**
IGPTW B3	29.18	-8.74
IBOV	-7.08	-48.25
IBRX 50	-10.42	-51.58
IBRX 100	-6.85	-48.77
ICO2	9.64	-41.66
IGC TRADE	-6.01	-47.04
IGC - NM	7.56	-33.66
ISE	25.58	-29.61

*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

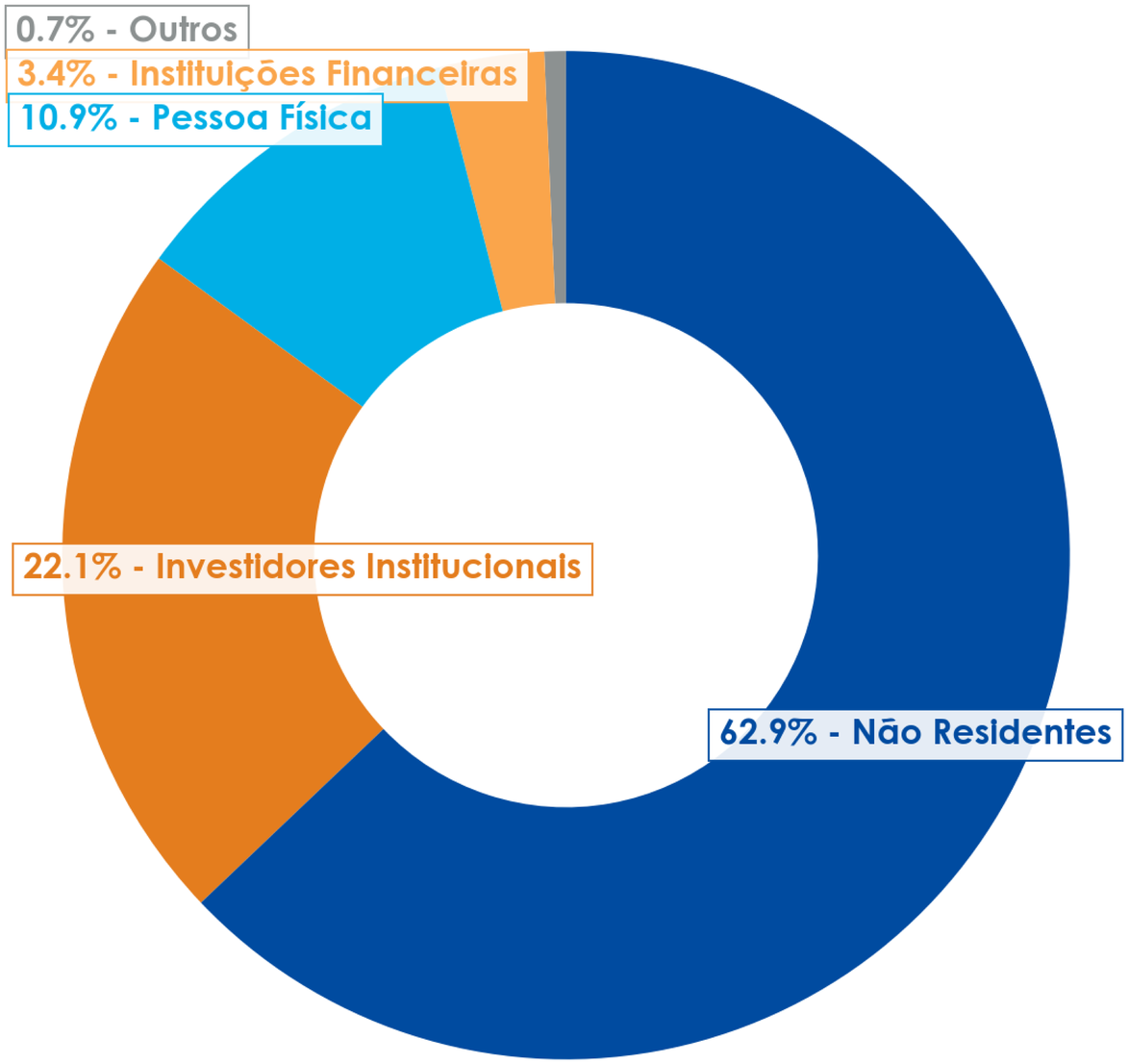


Composição ISE - TOP 15 Ativos

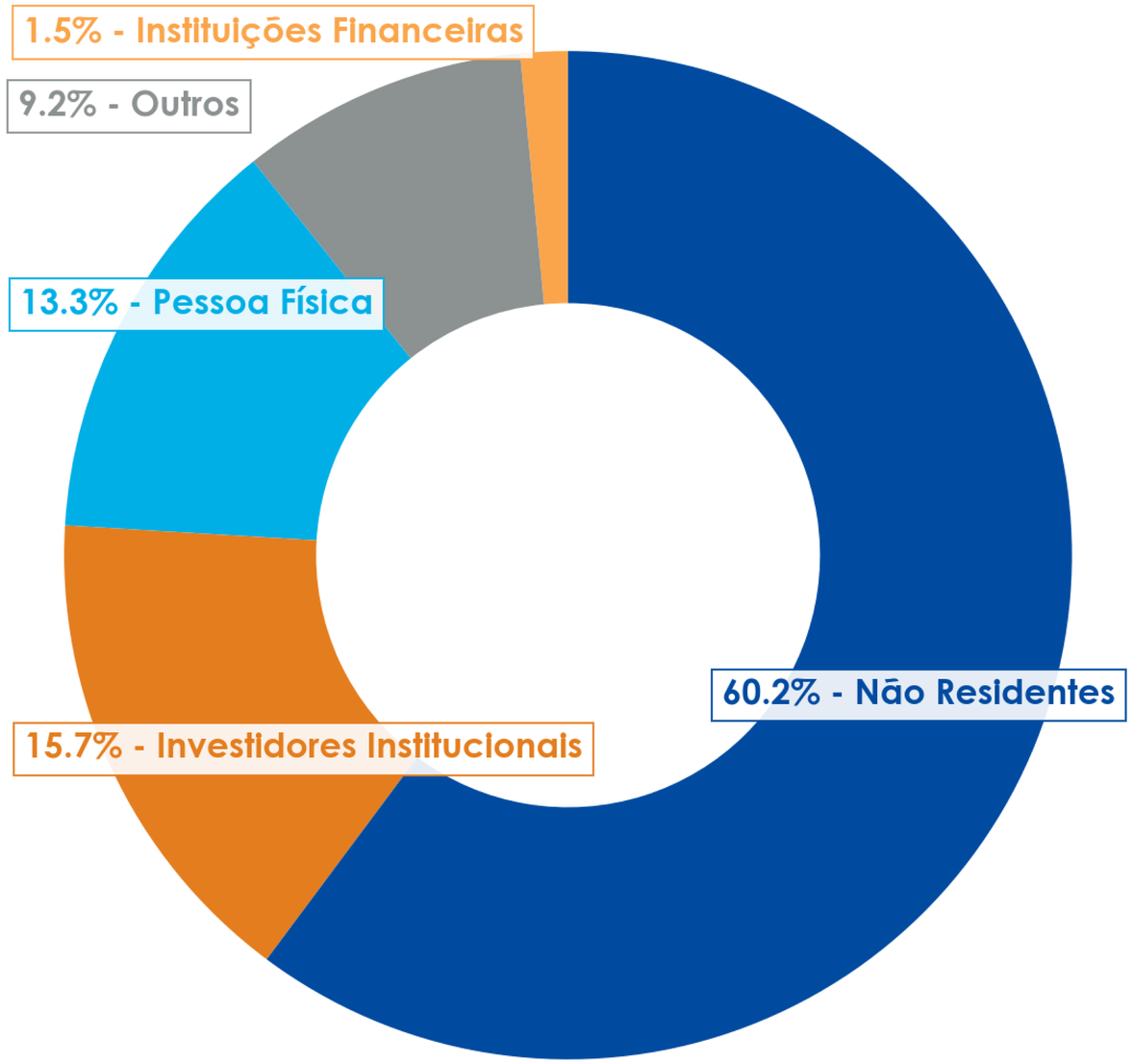
Ticker	Setor Econômico	% Mercado
VIVT3	Comunicação	3.06
TIMS3	Comunicação	2.71
SUZB3	Materiais Básicos	2.70
BRFS3	Consumo Não Cíclico	2.64
KLBN11	Materiais Básicos	2.62
BBAS3	Financeiro	2.61
ITUB4	Financeiro	2.55
SANB11	Financeiro	2.54
BBDC4	Financeiro	2.53
CPLE6	Utilidade Pública	2.50
EGIE3	Utilidade Pública	2.50
CCRO3	Bens Industriais	2.48
ELET3	Utilidade Pública	2.42
VBBR3	Petróleo e Gás	2.41
CMIG4	Utilidade Pública	2.39

Participação por Tipo Investidor*

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



Participação na posição em custódia (R$) – October/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	4.98	16.86	45.24	22.12	102.55	3.06
TIMS3	Comunicação	1.88	22.18	15.17	21.52	82.26	2.71
SUZB3	Materiais Básicos	-4.99	0.44	51.57	26.92	84.55	2.70
BRFS3	Consumo Não Cíclico	4.71	-15.05	10.67	61.76	120.30	2.64
KLBN11	Materiais Básicos	-8.92	7.29	21.40	23.46	86.57	2.62
BBAS3	Financeiro	2.48	45.96	48.35	26.56	82.23	2.61
ITUB4	Financeiro	-1.37	-6.51	26.82	25.39	97.24	2.55
SANB11	Financeiro	4.92	-4.02	26.92	27.03	94.74	2.54
BBDC4	Financeiro	-2.04	-24.69	13.99	34.78	121.44	2.53
CPLE6	Utilidade Pública	-2.73	22.94	8.39	34.85	143.89	2.50
EGIE3	Utilidade Pública	-5.14	6.44	39.30	18.16	101.68	2.50
CCRO3	Bens Industriais	-5.84	-3.93	11.98	28.81	87.62	2.48
ELET3	Utilidade Pública	-5.56	-29.61	34.84	31.95	91.03	2.42
VBBR3	Petróleo e Gás	4.60	13.74	19.79	37.18	104.59	2.41
CMIG4	Utilidade Pública	-5.40	13.55	11.74	26.02	83.80	2.39
ITSA4	Financeiro	-3.97	-3.30	8.64	22.49	96.23	2.37

*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
RAIL3	Bens Industriais	-2.23	1.11	22.31	30.45	88.31	2.36
RADL3	Saúde	-6.41	3.02	25.80	23.72	78.44	2.26
TRPL4	Utilidade Pública	-9.44	-9.44	21.19	17.01	98.44	2.25
BPAC11	Financeiro	-4.73	5.24	29.60	0.00	-	2.22
ENEV3	Utilidade Pública	-10.28	-23.70	10.82	32.05	92.76	2.20
WEGE3	Bens Industriais	-8.99	-16.76	33.01	27.01	72.98	2.16
ALOS3	Financeiro	1.37	8.40	22.90	33.96	-	2.14
CSAN3	Petróleo e Gás	-8.11	-4.05	15.75	32.55	93.62	2.12
ASAI3	Consumo Não Cíclico	-10.03	-44.47	10.94	42.61	116.90	2.11
NTCO3	Consumo Não Cíclico	-12.43	-14.72	12.75	53.14	79.68	2.06
B3SA3	Financeiro	-9.68	-23.75	11.10	40.25	100.12	2.05
LREN3	Consumo Cíclico	-8.51	-58.64	12.26	49.33	116.04	2.04
CPFE3	Utilidade Pública	-0.51	3.10	33.44	25.82	93.11	1.82
STBP3	Bens Industriais	-11.82	-12.49	7.40	38.54	80.21	1.81
ABEV3	Consumo Não Cíclico	-1.91	-15.39	12.86	20.89	87.15	1.79
RDOR3	Saúde	-14.24	-32.05	21.62	44.26	102.05	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
HYPE3	Saúde	-18.44	-38.59	30.29	28.73	99.10	1.62
FLRY3	Saúde	-1.06	-12.77	14.99	30.20	74.11	1.50
SAPR11	Utilidade Pública	-4.86	24.97	21.75	29.65	119.99	1.32
BRKM5	Materiais Básicos	-21.69	-52.33	16.07	48.53	97.35	1.29
COGN3	Consumo Cíclico	-9.77	-27.05	2.40	46.76	80.25	1.27
RAIZ4	Consumo Não Cíclico	2.10	-9.16	3.63	43.68	94.20	1.26
AZUL4	Bens Industriais	-11.05	-20.15	12.88	80.93	116.40	1.19
MGLU3	Consumo Cíclico	-37.26	-70.25	1.33	70.74	83.18	1.15
CIEL3	Financeiro	0.28	-37.24	3.52	37.39	76.74	1.11
SLCE3	Consumo Não Cíclico	-6.68	-5.66	36.76	25.83	64.83	1.06
ARZZ3	Consumo Cíclico	-10.11	-42.94	58.39	43.26	117.05	1.06
NEOE3	Utilidade Pública	-4.83	13.20	17.52	28.05	107.84	1.01
USIM5	Materiais Básicos	-0.45	-4.15	6.61	35.97	78.28	0.98
AESB3	Utilidade Pública	-7.70	1.73	10.07	23.49	93.14	0.94
VAMO3	Consumo Cíclico	-19.69	-50.31	7.83	47.16	95.27	0.94
MRVE3	Consumo Cíclico	-22.68	-18.96	8.25	53.18	94.27	0.91

*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
ECOR3	Bens Industriais	-9.30	29.29	7.02	46.70	103.14	0.69
BPAN4	Financeiro	-13.00	-5.25	7.03	42.15	70.12	0.67
MDIA3	Consumo Não Cíclico	-10.79	-24.68	32.59	40.38	92.70	0.62
DXCO3	Materiais Básicos	-10.91	-18.50	6.86	45.37	106.70	0.59
BEEF3	Consumo Não Cíclico	-6.43	-41.32	7.57	44.60	114.12	0.58
MRFG3	Consumo Não Cíclico	-9.40	-31.34	6.46	44.68	102.57	0.54
GRND3	Consumo Cíclico	-7.46	3.24	6.20	32.18	88.55	0.48
SIMH3	Financeiro	-21.72	-34.55	6.92	50.24	106.37	0.46
MYPK3	Consumo Cíclico	-17.66	-18.54	11.28	36.90	95.57	0.43
DASA3	Saúde	-21.67	-51.29	9.69	70.94	149.92	0.40
RANI3	Materiais Básicos	-14.76	39.40	10.80	32.08	79.94	0.33
MOVI3	Consumo Cíclico	-26.35	-33.60	8.75	61.17	138.49	0.32
BHIA3	Consumo Cíclico	-28.57	-85.62	0.45	71.41	-	0.31
CBAV3	Materiais Básicos	-16.85	-62.88	3.80	54.86	91.51	0.21
AMBP3	Utilidade Pública	-33.96	-56.07	13.65	51.72	97.04	0.18
PCAR3	Consumo Não Cíclico	3.43	-60.36	3.62	56.85	135.32	0.16

*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	-10.42	-51.44	4.73	69.21	116.83	0.11
GFSA3	Consumo Cíclico	25.36	-32.03	5.19	129.45	205.51	0.09
AERI3	Bens Industriais	2.41	-54.05	0.85	76.25	121.13	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