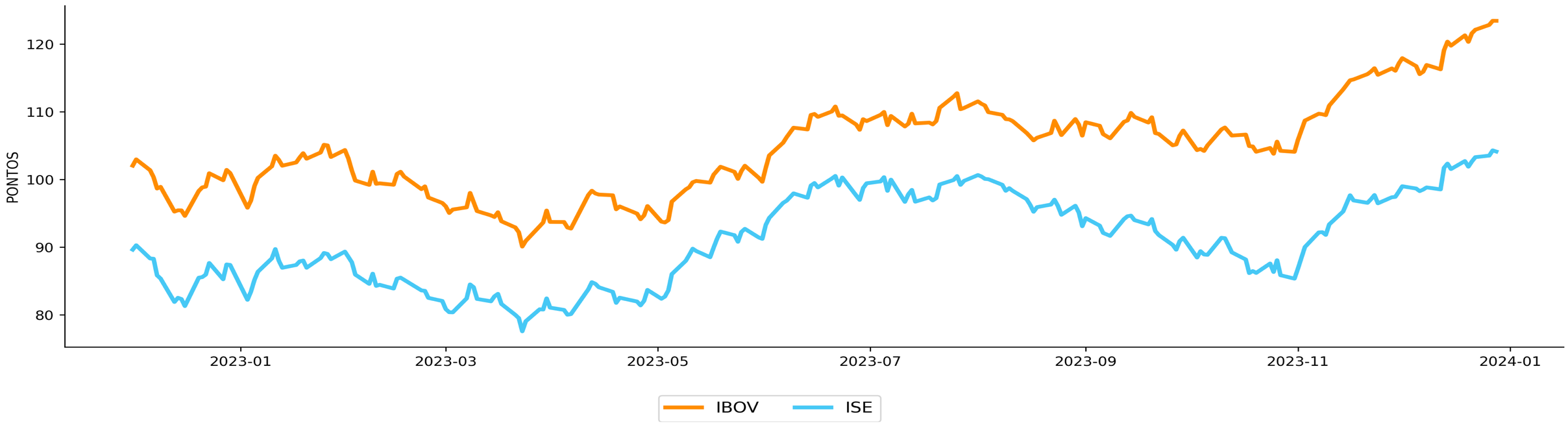
Boletim Mensal de ISE

December/2023

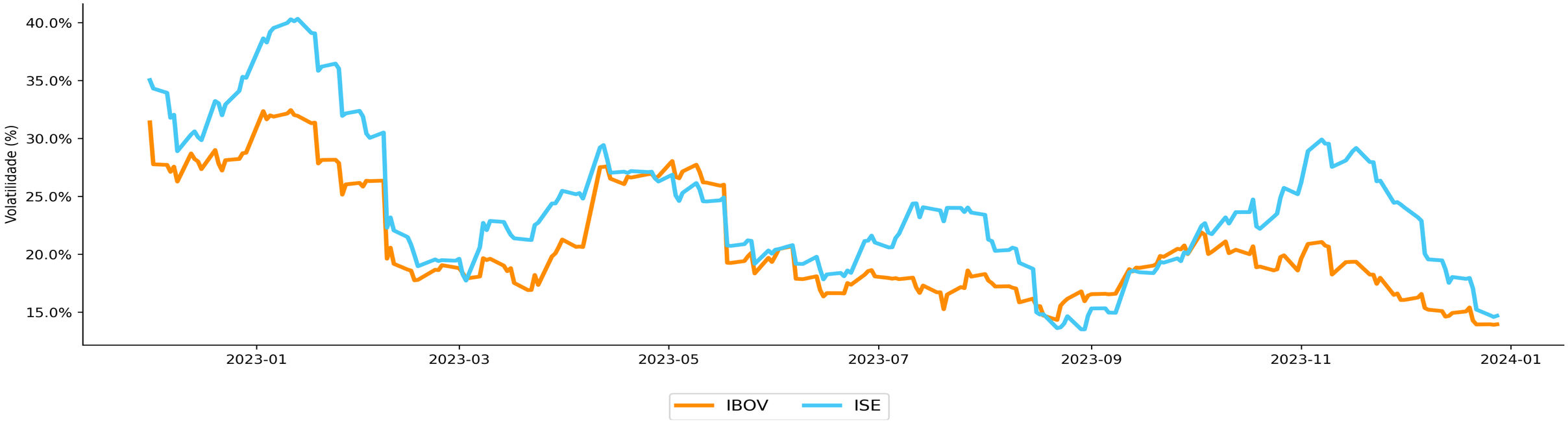
Comparativo ISE e Outros Indicadores



Indice	Variação MoM (%)	Variação YTD (%)	Variação 12M (%)	Variação Total (%)*
IGPTW B3	8.08	14.80	9.61	0.64
IBOV	5.38	28.82	22.28	23.42
IBRX 50	5.31	26.03	20.06	24.70
IBRX 100	5.48	27.45	21.27	24.10
ICO2	5.80	32.94	25.09	-0.89
IGC TRADE	5.68	28.65	22.24	25.48
IGC - NM	5.43	20.93	14.68	13.26
ISE	6.04	26.66	19.18	4.11

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

Volatilidade ISE e Outros Indicadores

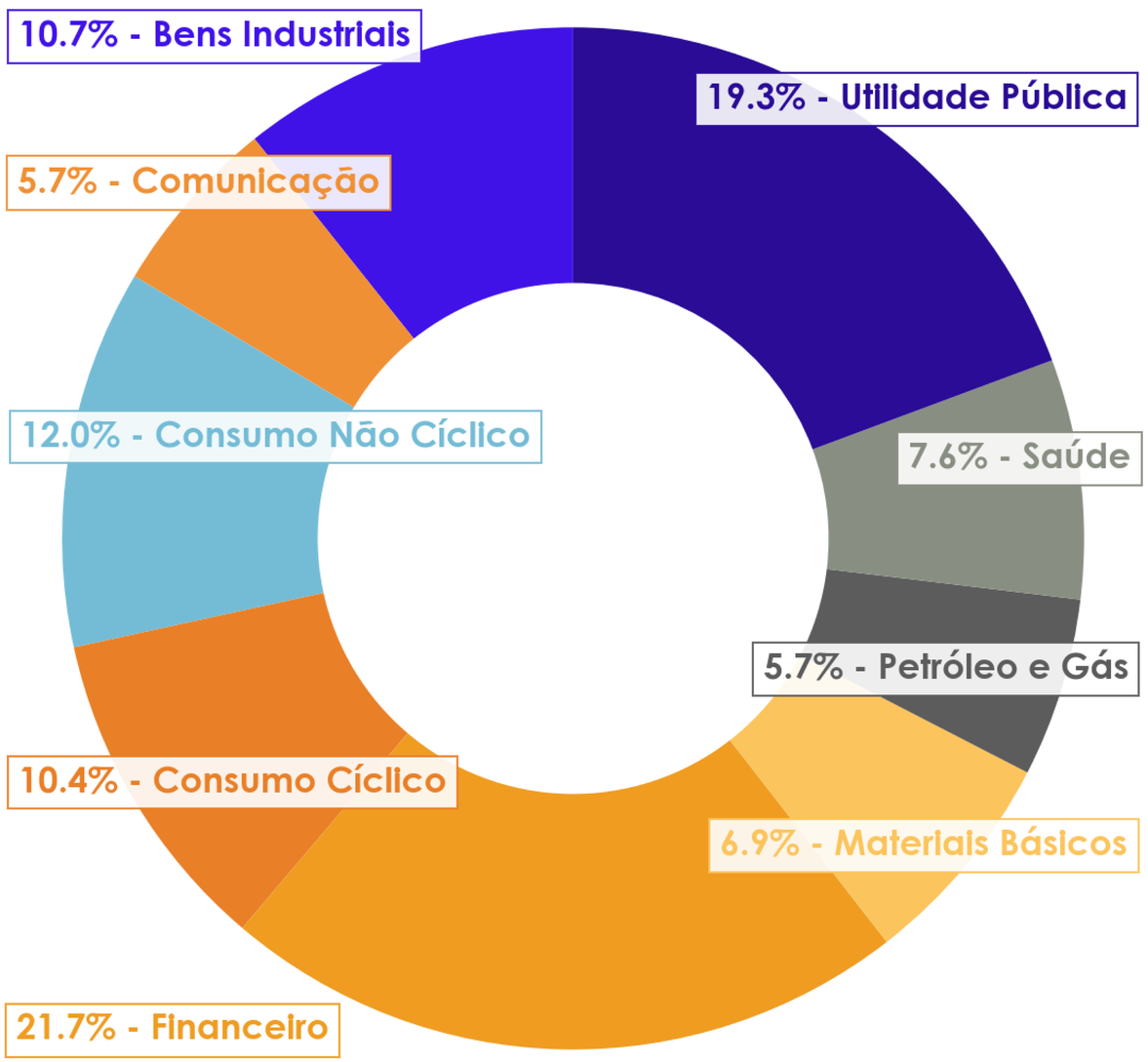


Variação Índice	Varição - Mês (%)*	Variação - Ano (%)**
IGPTW B3	-34.93	-58.06
IBOV	-13.08	-51.53
IBRX 50	-8.21	-50.66
IBRX 100	-12.95	-51.80
ICO2	-30.21	-57.01
IGC TRADE	-15.75	-53.82
IGC - NM	-26.65	-53.29
ISE	-39.58	-58.35

*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

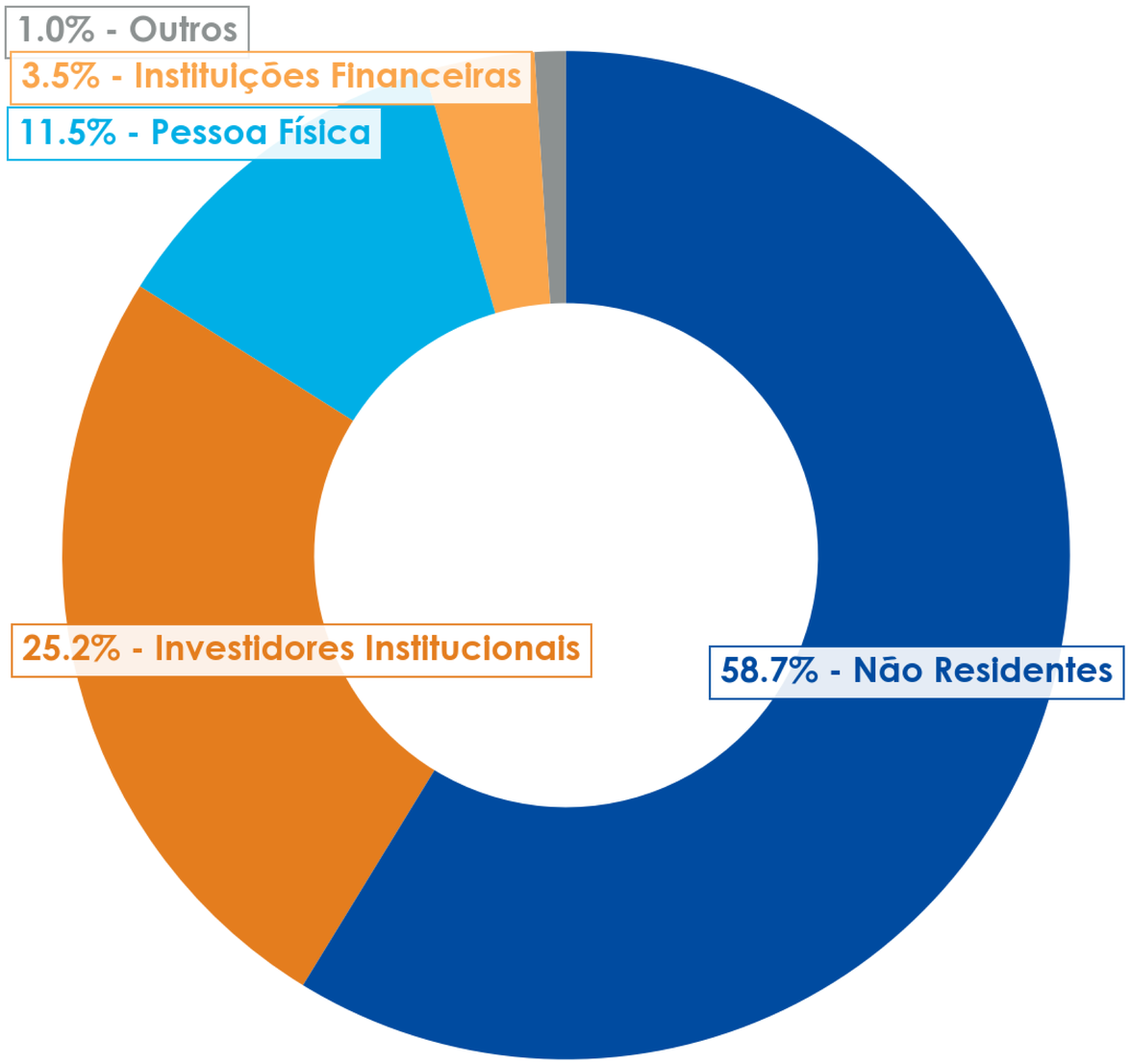


Composição ISE - TOP 15 Ativos

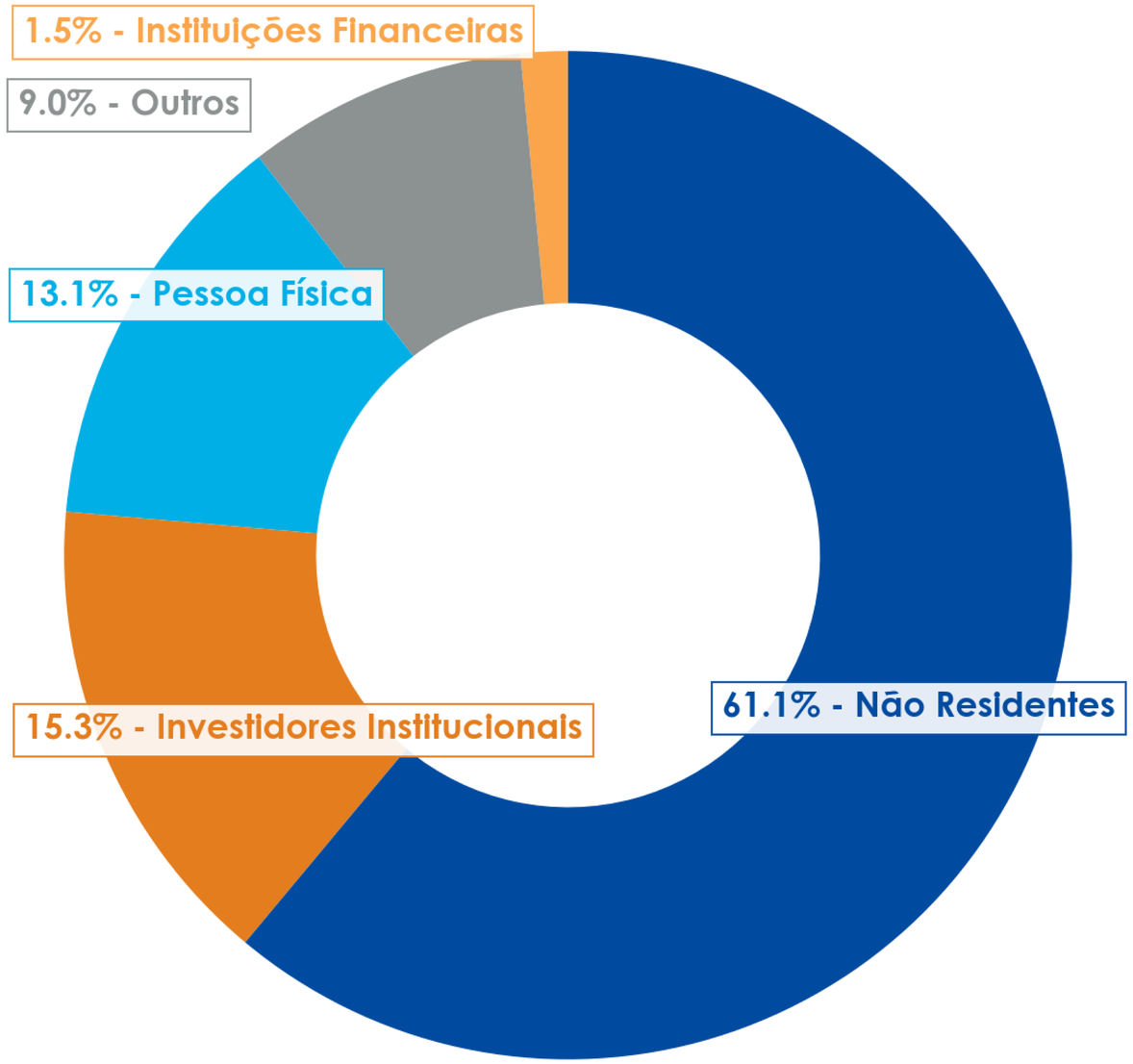
Ticker	Setor Econômico	% Mercado
VIVT3	Comunicação	3.01
BRFS3	Consumo Não Cíclico	3.00
TIMS3	Comunicação	2.70
ITUB4	Financeiro	2.64
CPLE6	Utilidade Pública	2.56
SANB11	Financeiro	2.52
BBDC4	Financeiro	2.51
LREN3	Consumo Cíclico	2.49
ITSA4	Financeiro	2.47
ELET3	Utilidade Pública	2.46
BBAS3	Financeiro	2.44
CCRO3	Bens Industriais	2.43
SUZB3	Materiais Básicos	2.40
EGIE3	Utilidade Pública	2.37
BPAC11	Financeiro	2.33

Participação por Tipo Investidor*

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



Participação na posição em custódia (R$) – December/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	2.27	50.14	53.44	21.52	98.22	3.01
BRFS3	Consumo Não Cíclico	-5.80	66.79	13.81	61.24	108.76	3.00
TIMS3	Comunicação	5.59	53.70	17.93	21.47	88.46	2.70
ITUB4	Financeiro	8.44	42.31	33.97	23.31	87.53	2.64
CPLE6	Utilidade Pública	9.51	36.05	10.36	23.48	66.42	2.56
SANB11	Financeiro	4.19	21.65	32.30	25.24	85.53	2.52
BBDC4	Financeiro	9.53	25.65	17.09	29.60	88.62	2.51
LREN3	Consumo Cíclico	7.49	-11.22	17.42	47.42	106.68	2.49
ITSA4	Financeiro	7.46	36.97	10.37	21.35	87.11	2.47
ELET3	Utilidade Pública	3.84	1.39	42.43	30.14	88.86	2.46
BBAS3	Financeiro	2.71	76.18	55.39	24.48	72.55	2.44
CCRO3	Bens Industriais	4.73	33.15	14.18	25.30	73.59	2.43
SUZB3	Materiais Básicos	5.86	18.02	55.63	25.27	78.36	2.40
EGIE3	Utilidade Pública	4.62	28.17	45.33	17.01	85.09	2.37
BPAC11	Financeiro	6.53	61.18	37.61	0.00	-	2.33
NTCO3	Consumo Não Cíclico	2.43	45.48	16.89	49.79	74.09	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
VBBR3	Petróleo e Gás	-0.75	52.39	22.76	35.41	96.56	2.30
ENEV3	Utilidade Pública	7.25	14.08	13.61	31.79	88.53	2.28
TRPL4	Utilidade Pública	19.84	25.78	26.50	21.00	110.70	2.24
B3SA3	Financeiro	9.40	13.56	14.55	35.49	81.74	2.23
KLBN11	Materiais Básicos	-0.84	18.71	22.22	22.56	80.66	2.21
CSAN3	Petróleo e Gás	9.07	16.16	19.36	31.23	83.50	2.19
RADL3	Saúde	5.06	30.37	29.40	22.66	74.44	2.16
ASAI3	Consumo Não Cíclico	4.64	-30.22	13.53	44.22	124.63	2.15
ALOS3	Financeiro	3.79	60.56	26.55	29.09	-	2.06
RAIL3	Bens Industriais	0.22	23.74	22.95	26.22	72.27	2.04
WEGE3	Bens Industriais	8.17	-2.60	36.91	25.22	70.35	2.04
STBP3	Bens Industriais	12.25	26.26	9.37	33.71	74.19	1.95
RDOR3	Saúde	8.82	-1.36	28.76	42.83	92.55	1.92
CMIG4	Utilidade Pública	9.43	15.10	11.48	25.30	73.59	1.89
CPFE3	Utilidade Pública	3.94	26.67	38.51	22.63	77.63	1.75
ABEV3	Consumo Não Cíclico	5.53	-0.50	13.73	20.79	82.57	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
HYPE3	Saúde	6.75	-18.39	35.75	29.25	96.28	1.62
MGLU3	Consumo Cíclico	6.93	-21.17	2.16	77.08	92.72	1.57
FLRY3	Saúde	6.59	25.82	18.04	28.89	72.92	1.55
COGN3	Consumo Cíclico	8.05	64.62	3.49	45.99	83.09	1.53
SAPR11	Utilidade Pública	11.28	77.75	29.19	23.58	81.09	1.41
AZUL4	Bens Industriais	-5.21	45.41	16.01	78.74	114.88	1.32
CIEL3	Financeiro	16.67	-5.90	4.69	35.61	74.09	1.27
RAIZ4	Petróleo e Gás	14.07	16.55	4.03	43.34	94.75	1.18
USIM5	Materiais Básicos	18.19	36.03	9.29	30.34	65.50	1.17
VAMO3	Consumo Cíclico	12.68	-17.59	10.07	48.41	101.47	1.02
ARZZ3	Consumo Cíclico	8.75	-15.08	64.53	42.10	114.93	1.01
MRVE3	Consumo Cíclico	16.13	47.76	11.23	53.94	96.42	1.01
NEOE3	Utilidade Pública	10.17	48.05	21.34	26.11	96.20	0.99
AESB3	Utilidade Pública	13.34	27.54	12.32	21.16	85.98	0.97
SLCE3	Consumo Não Cíclico	0.18	-5.82	18.82	24.54	64.83	0.94
ECOR3	Bens Industriais	8.90	113.88	9.42	43.10	87.19	0.78

*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	11.38	45.88	8.64	39.24	76.57	0.71
MRFG3	Consumo Não Cíclico	-0.21	12.13	9.70	42.82	92.62	0.69
MDIA3	Consumo Não Cíclico	10.89	9.63	38.63	40.68	90.20	0.60
DXCO3	Materiais Básicos	14.09	22.17	8.07	44.95	100.00	0.59
SIMH3	Financeiro	13.56	42.85	9.63	47.18	96.01	0.54
BEEF3	Consumo Não Cíclico	2.89	-38.88	7.47	43.02	102.38	0.48
GRND3	Consumo Cíclico	7.28	41.00	7.07	29.04	76.00	0.45
MYPK3	Consumo Cíclico	7.87	12.46	12.89	35.39	85.84	0.40
AMBP3	Utilidade Pública	8.91	-21.75	16.25	49.30	93.34	0.40
MOVI3	Consumo Cíclico	6.83	57.81	11.89	56.22	108.70	0.36
DASA3	Saúde	4.68	-29.93	9.62	70.81	148.70	0.34
RANI3	Materiais Básicos	6.23	48.82	10.92	31.39	81.72	0.27
CBAV3	Materiais Básicos	23.19	-52.69	5.10	53.91	89.63	0.27
BHIA3	Consumo Cíclico	-15.70	-81.03	11.38	73.99	-	0.27
AERI3	Bens Industriais	3.45	-20.35	0.90	70.60	91.32	0.16
PCAR3	Consumo Não Cíclico	21.19	-40.66	4.06	56.34	120.77	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
GFSA3	Consumo Cíclico	59.08	5.25	10.42	128.09	107.81	0.14
GUAR3	Consumo Cíclico	7.04	0.31	6.54	69.27	115.22	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;

BRASIL
BOLSA
BALCÃO