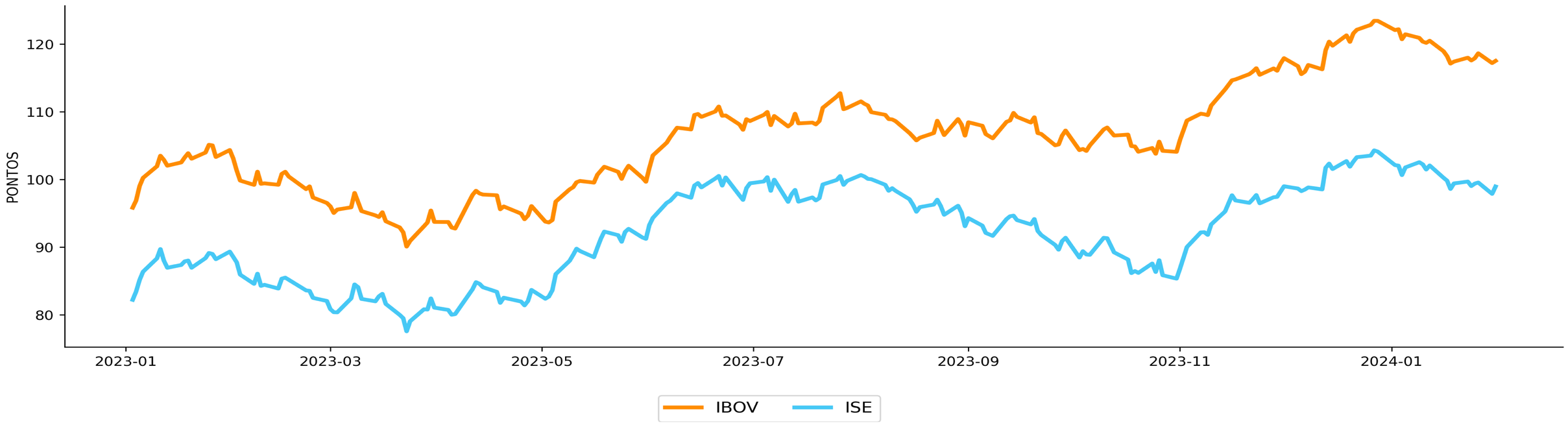
Boletim Mensal de ISE

January/2024

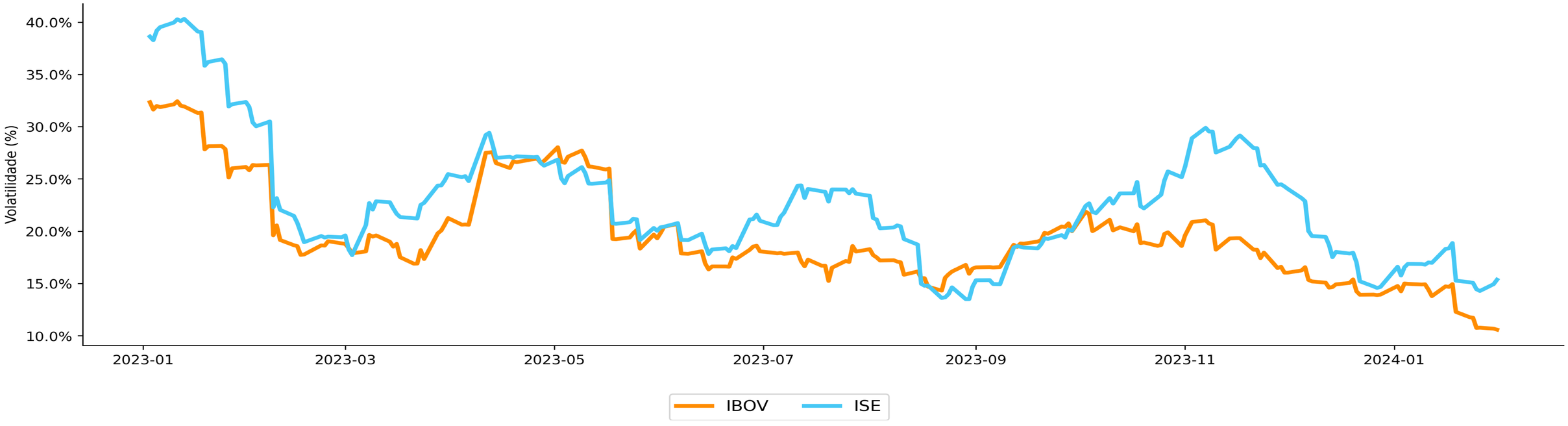
Comparativo ISE e Outros Indicadores



Indice	Variação MoM (%)	Variação YTD (%)	Variação 12M (%)	Variação Total (%)*
IGPTW B3	-5.86	-3.05	0.81	-5.26
IBOV	-4.79	-3.73	12.63	17.51
IBRX 50	-4.15	-3.24	11.32	19.53
IBRX 100	-4.51	-3.47	11.88	18.51
ICO2	-4.86	-3.50	16.63	-5.70
IGC TRADE	-4.51	-3.32	12.65	19.82
IGC - NM	-6.71	-5.12	2.31	5.66
ISE	-4.96	-3.10	10.77	-1.05

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

Volatilidade ISE e Outros Indicadores

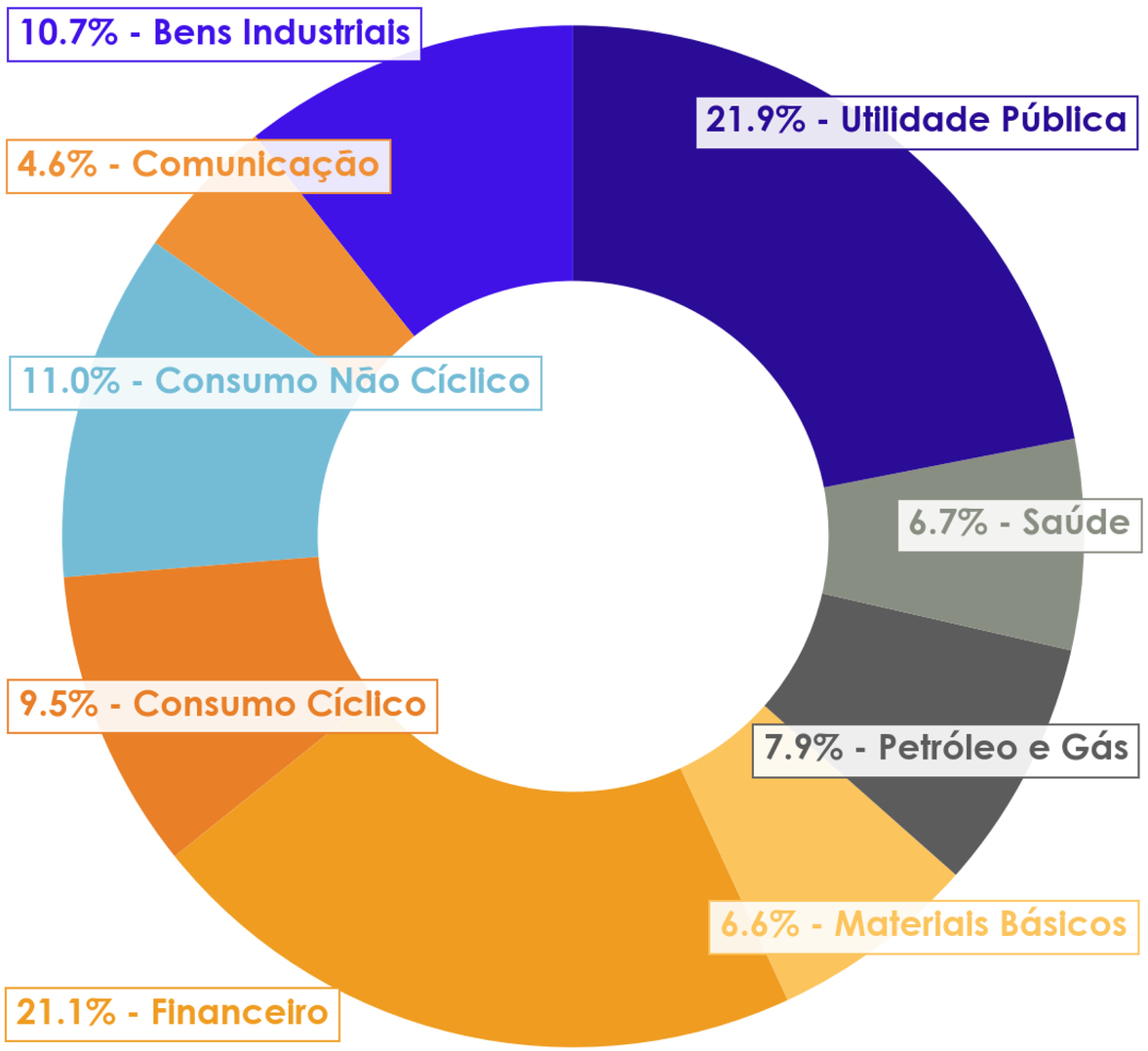


Variação Índice	Varição - Mês (%)*	Variação - Ano (%)**
IGPTW B3	8.17	-41.66
IBOV	-24.09	-59.54
IBRX 50	-26.64	-58.39
IBRX 100	-24.27	-58.25
ICO2	-13.98	-60.06
IGC TRADE	-20.35	-57.76
IGC - NM	-14.50	-54.97
ISE	4.72	-52.53

*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

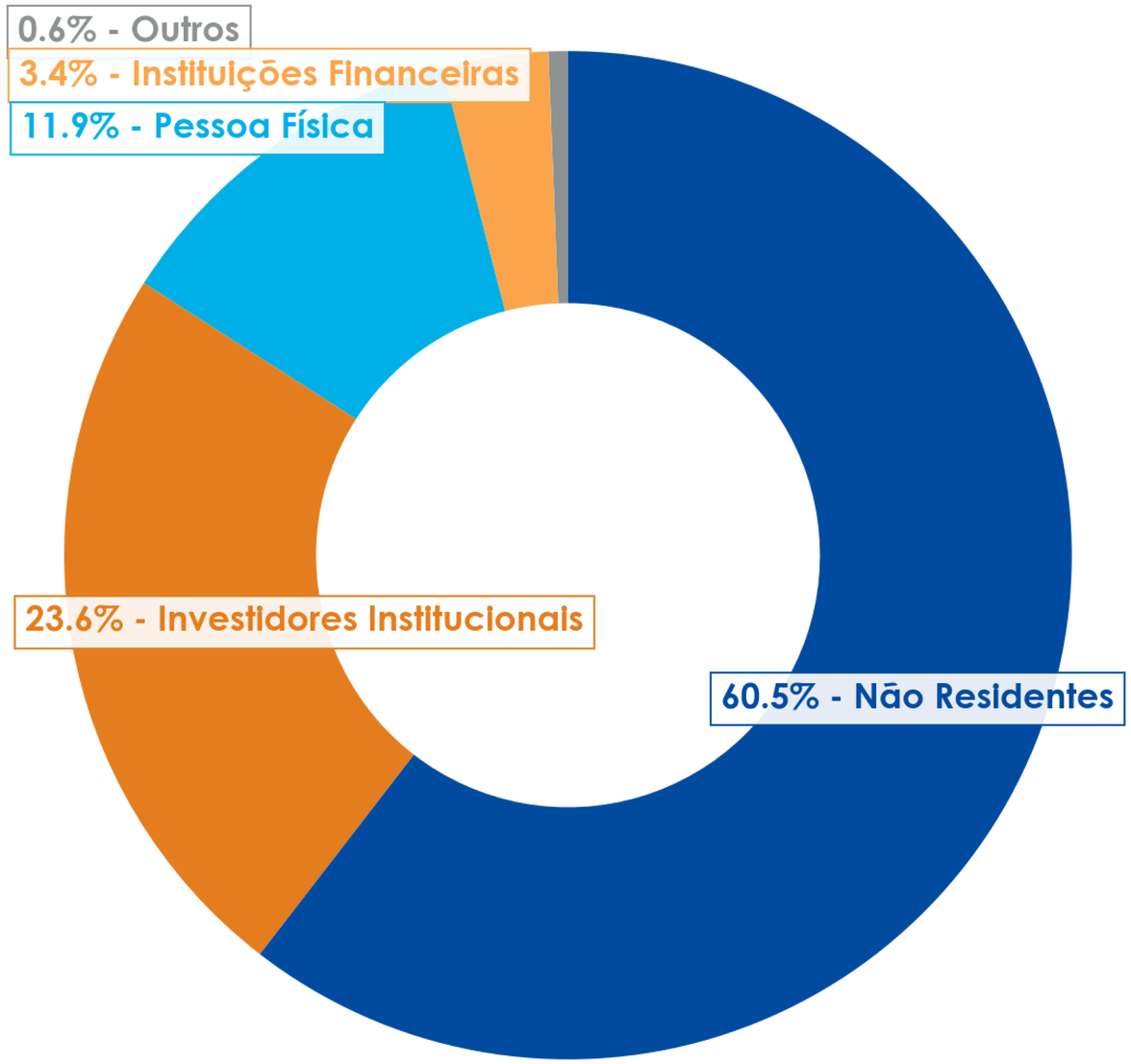


Composição ISE - TOP 15 Ativos

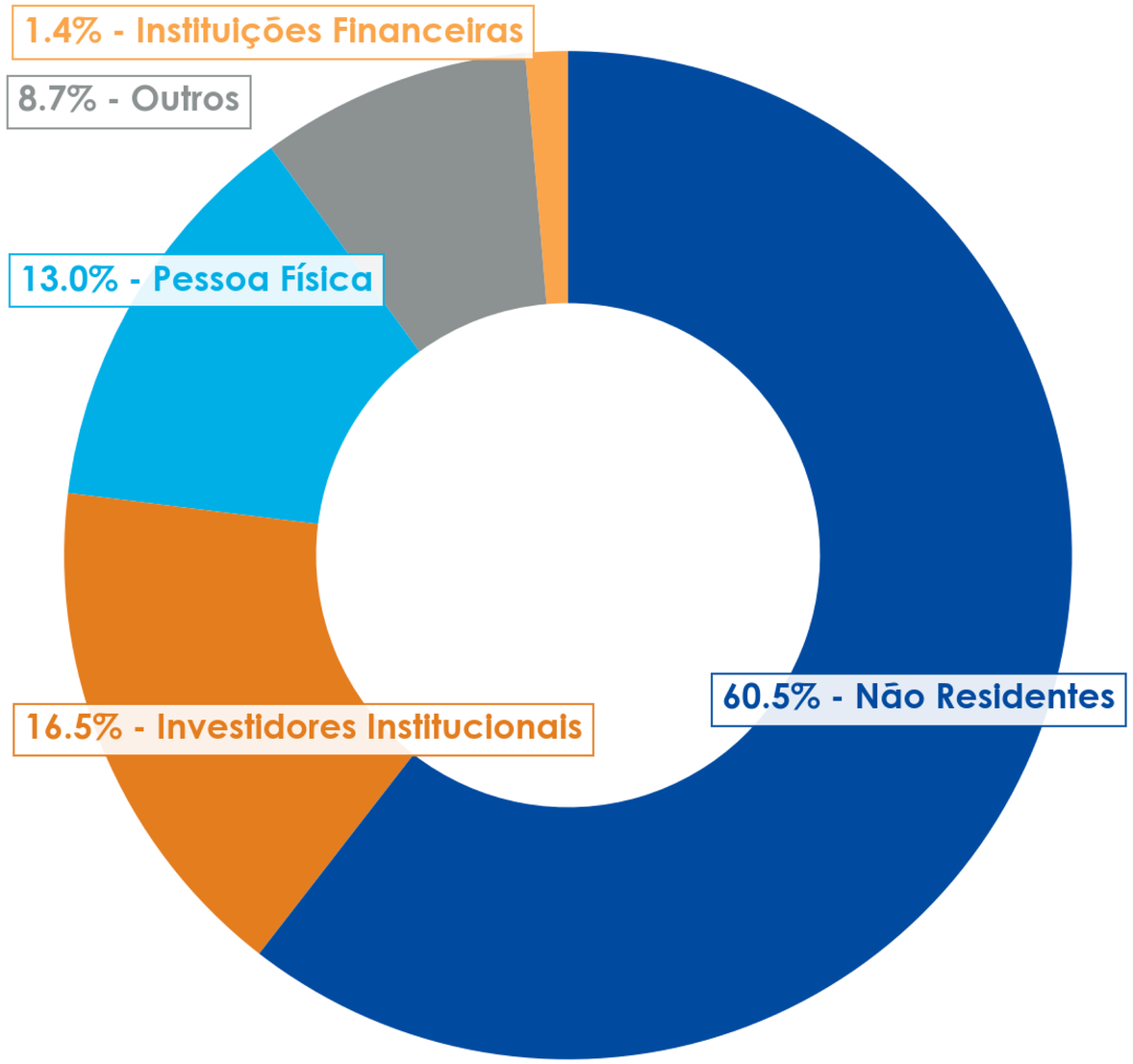
Ticker	Setor Econômico	% Mercado
VIVT3	Comunicação	2.34
BBAS3	Financeiro	2.32
KLBN11	Materiais Básicos	2.30
CMIG4	Utilidade Pública	2.25
TIMS3	Comunicação	2.23
SUZB3	Materiais Básicos	2.22
TRPL4	Utilidade Pública	2.21
CPLE6	Utilidade Pública	2.20
NTCO3	Consumo Não Cíclico	2.19
RAIL3	Bens Industriais	2.18
ITUB4	Financeiro	2.15
VBBR3	Petróleo e Gás	2.15
LREN3	Consumo Cíclico	2.15
ITSA4	Financeiro	2.14
CSAN3	Petróleo e Gás	2.13

Participação por Tipo Investidor*

Participação no volume negociado (R$) – January/2024



Participação na posição em custódia (R$) – January/2024



*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	-3.89	28.76	51.36	19.83	90.51	2.34
BBAS3	Financeiro	1.91	53.21	56.45	22.67	67.19	2.32
KLBN11	Materiais Básicos	-4.19	17.45	21.29	22.70	81.16	2.30
CMIG4	Utilidade Pública	0.35	12.28	11.52	24.14	70.22	2.25
TIMS3	Comunicação	-3.29	56.34	17.34	21.02	86.61	2.23
SUZB3	Materiais Básicos	-7.21	13.95	51.62	24.94	77.33	2.22
TRPL4	Utilidade Pública	-3.36	22.25	25.61	20.97	110.54	2.21
CPLE6	Utilidade Pública	-2.22	35.43	10.13	22.23	62.89	2.20
NTCO3	Consumo Não Cíclico	-5.27	9.97	16.00	46.82	69.67	2.19
RAIL3	Bens Industriais	0.48	25.89	23.06	26.45	72.91	2.18
ITUB4	Financeiro	-3.45	35.51	32.78	22.48	84.42	2.15
VBBR3	Petróleo e Gás	4.35	50.22	23.75	34.65	94.49	2.15
LREN3	Consumo Cíclico	-7.86	-22.55	16.05	47.00	105.74	2.15
ITSA4	Financeiro	-3.57	31.77	10.00	20.87	85.15	2.14
CSAN3	Petróleo e Gás	-5.63	12.37	18.27	29.47	78.80	2.13
EGIE3	Utilidade Pública	-10.48	10.45	40.58	16.86	84.34	2.13

*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
BRFS3	Consumo Não Cíclico	1.01	75.25	13.95	59.58	105.81	2.13
SANB11	Financeiro	-10.10	4.82	28.65	23.40	79.30	2.10
ASAI3	Consumo Não Cíclico	0.96	-30.20	13.66	45.64	128.64	2.09
BPAC11	Financeiro	-3.84	70.47	36.02	0.00	-	2.09
BBDC4	Financeiro	-10.08	17.21	15.35	27.92	83.59	2.09
ELET3	Utilidade Pública	-3.82	1.05	40.81	29.57	87.18	2.09
RDOR3	Saúde	-5.60	-13.65	27.15	39.89	86.19	2.08
CCRO3	Bens Industriais	-7.48	13.35	13.12	23.17	67.39	2.06
STBP3	Bens Industriais	7.58	20.41	10.08	32.53	71.59	2.01
B3SA3	Financeiro	-9.41	4.36	13.09	34.21	78.79	1.99
ENEV3	Utilidade Pública	-6.25	6.33	12.76	30.03	83.63	1.98
RADL3	Saúde	-13.95	7.17	25.30	22.93	75.33	1.97
UGPA3	Petróleo e Gás	6.26	118.07	28.17	28.88	69.09	1.85
WEGE3	Bens Industriais	-12.38	-14.05	32.34	24.51	68.37	1.83
ALOS3	Financeiro	-7.53	40.22	24.55	28.15	-	1.69
HYPE3	Saúde	-11.24	-29.44	31.73	28.85	94.96	1.69

*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	-4.73	0.76	13.08	19.39	77.01	1.67
EQTL3	Utilidade Pública	-0.81	28.22	35.43	21.92	82.22	1.67
CPFE3	Utilidade Pública	-5.84	18.98	36.26	22.22	76.23	1.57
MGLU3	Consumo Cíclico	-2.78	-52.60	2.10	75.11	90.35	1.33
SAPR11	Utilidade Pública	-1.73	73.63	28.08	23.88	82.12	1.30
COGN3	Consumo Cíclico	-16.33	22.69	2.92	44.64	80.65	1.23
CIEL3	Financeiro	7.49	5.79	4.97	35.98	74.86	1.21
IGTI11	Financeiro	-2.05	24.28	23.88	26.70	69.37	1.21
PSSA3	Financeiro	-7.17	8.28	26.68	22.01	72.95	1.13
USIM5	Materiais Básicos	-1.08	12.95	9.19	30.33	65.48	1.09
RAIZ4	Petróleo e Gás	-4.96	25.92	3.83	41.40	90.51	1.06
AZUL4	Bens Industriais	-16.30	13.08	13.40	79.30	115.70	1.01
CSMG3	Utilidade Pública	4.35	71.21	21.37	29.26	73.50	0.94
NEOE3	Utilidade Pública	-2.46	45.62	20.40	26.02	95.87	0.93
AURE3	Utilidade Pública	-0.98	5.09	13.18	15.28	50.13	0.92
FLRY3	Saúde	-9.81	13.26	16.27	26.43	66.71	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
SLCE3	Consumo Não Cíclico	1.49	-12.60	19.10	24.98	66.00	0.87
AESB3	Utilidade Pública	-7.55	12.77	11.39	21.68	88.09	0.84
ARZZ3	Consumo Cíclico	-3.01	-26.42	62.59	43.93	119.93	0.81
VAMO3	Consumo Cíclico	-18.87	-42.19	8.17	47.44	99.43	0.79
SOMA3	Consumo Cíclico	6.31	-23.65	7.92	54.41	107.15	0.79
ENAT3	Petróleo e Gás	-5.82	27.37	18.92	44.03	88.02	0.76
PORT3	Bens Industriais	-2.72	74.11	16.85	25.98	92.29	0.72
SRNA3	Utilidade Pública	-5.48	9.29	9.65	43.65	-	0.72
MRFG3	Consumo Não Cíclico	-2.99	22.90	9.41	42.30	91.50	0.71
ECOR3	Bens Industriais	-3.72	101.85	9.07	41.34	83.63	0.70
MRVE3	Consumo Cíclico	-29.83	12.25	7.88	55.73	99.62	0.67
BPAN4	Financeiro	-9.03	38.89	7.86	39.25	76.59	0.60
MDIA3	Consumo Não Cíclico	-0.85	13.81	38.30	40.40	89.58	0.59
DXCO3	Materiais Básicos	-4.09	5.36	7.74	44.94	99.98	0.54
GRND3	Consumo Cíclico	-4.24	24.49	6.77	27.74	72.60	0.42
BEEF3	Consumo Não Cíclico	-8.30	-48.08	6.85	42.17	100.36	0.42

*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
SIMH3	Financeiro	-18.90	0.79	7.81	46.52	94.67	0.40
MYPK3	Consumo Cíclico	-3.65	11.29	12.42	32.86	79.70	0.36
MOVI3	Consumo Cíclico	-22.04	24.50	9.27	56.09	108.45	0.27
RANI3	Materiais Básicos	-10.81	34.58	9.74	31.83	82.87	0.24
CAML3	Consumo Não Cíclico	5.09	11.19	8.88	37.83	79.39	0.20
GFSA3	Consumo Cíclico	35.22	8.72	14.09	95.86	80.68	0.19
AMBP3	Utilidade Pública	-15.45	-42.26	13.74	48.41	91.65	0.18
CBAV3	Materiais Básicos	-21.18	-66.09	4.02	53.93	89.66	0.18
CEAB3	Consumo Cíclico	-6.77	144.97	7.30	70.89	98.40	0.17
BHIA3	Consumo Cíclico	-30.67	-86.85	7.89	73.06	-	0.17
JSLG3	Bens Industriais	-12.29	72.85	10.92	41.46	87.58	0.16
PCAR3	Consumo Não Cíclico	-3.69	-54.44	3.91	62.94	134.92	0.15
GUAR3	Consumo Cíclico	-19.42	3.33	5.27	69.09	114.92	0.10
MTRE3	Consumo Cíclico	-20.78	14.65	4.88	54.40	96.69	0.06

*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