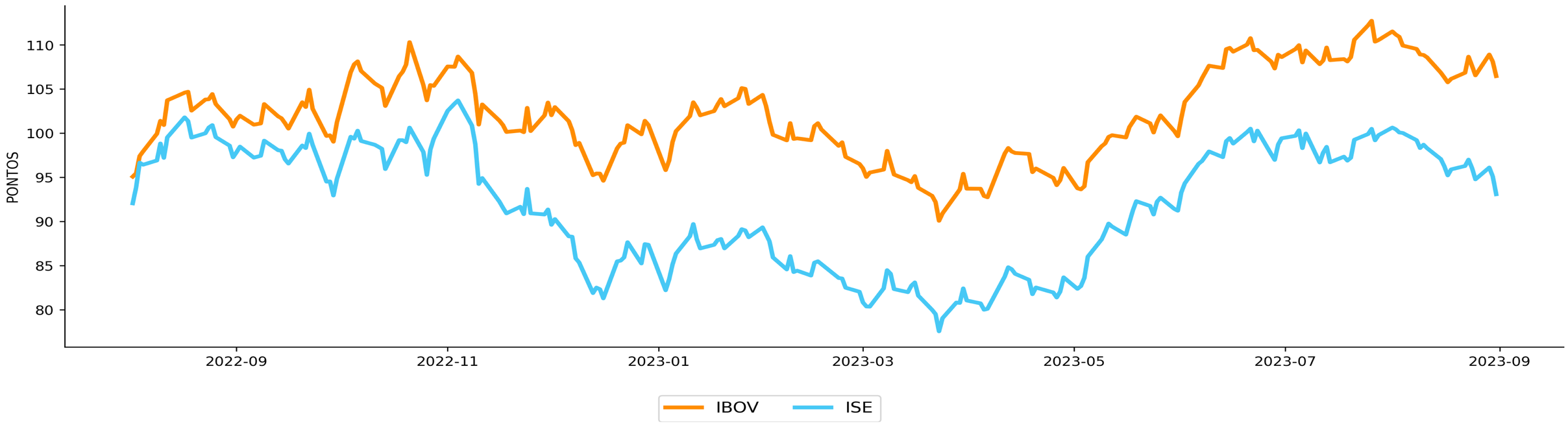
Boletim Mensal de ISE

August/2023

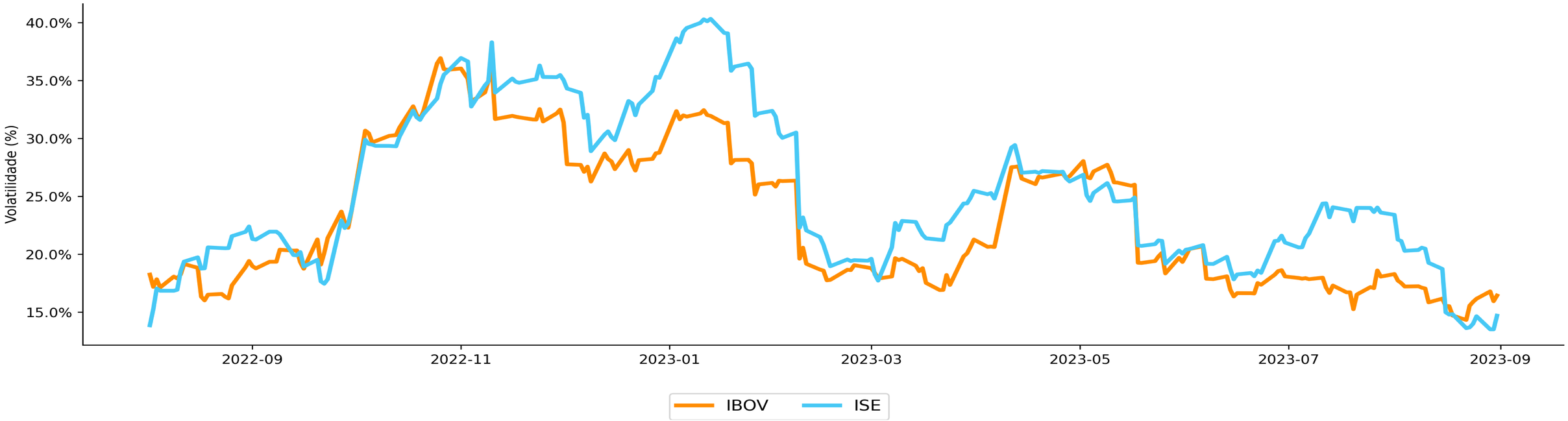
Comparativo ISE e Outros Indicadores



Indice	Variação MoM (%)	Variação YTD (%)	Variação 12M (%)	Variação Total (%)*
IGPTW B3	-8.22	5.39	-9.07	-7.61
IBOV	-3.70	11.11	5.68	6.46
IBRX 50	-3.22	8.82	4.56	7.67
IBRX 100	-3.62	9.94	4.16	7.06
ICO2	-5.54	15.59	1.30	-13.82
IGC TRADE	-3.55	11.29	4.82	8.55
IGC - NM	-5.29	6.65	4.30	-0.11
ISE	-6.71	13.24	-4.30	-6.92

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

Volatilidade ISE e Outros Indicadores

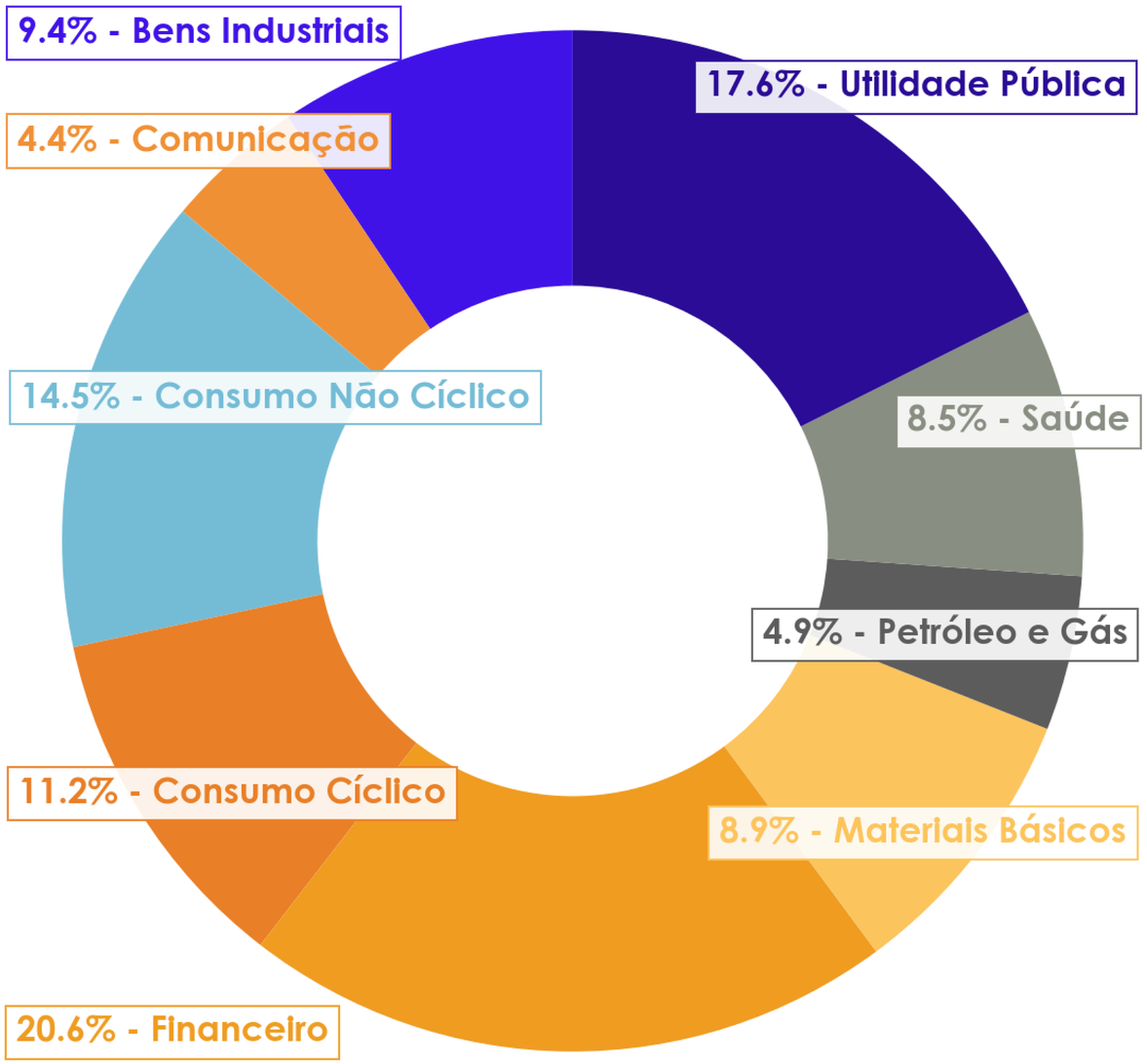


Variação Índice	Varição - Mês (%)*	Variação - Ano (%)**
IGPTW B3	-25.41	-22.24
IBOV	-9.02	-15.37
IBRX 50	-6.39	-20.26
IBRX 100	-8.95	-16.45
ICO2	-19.42	-20.32
IGC TRADE	-9.90	-17.36
IGC - NM	-26.86	-31.65
ISE	-37.73	-34.40

*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

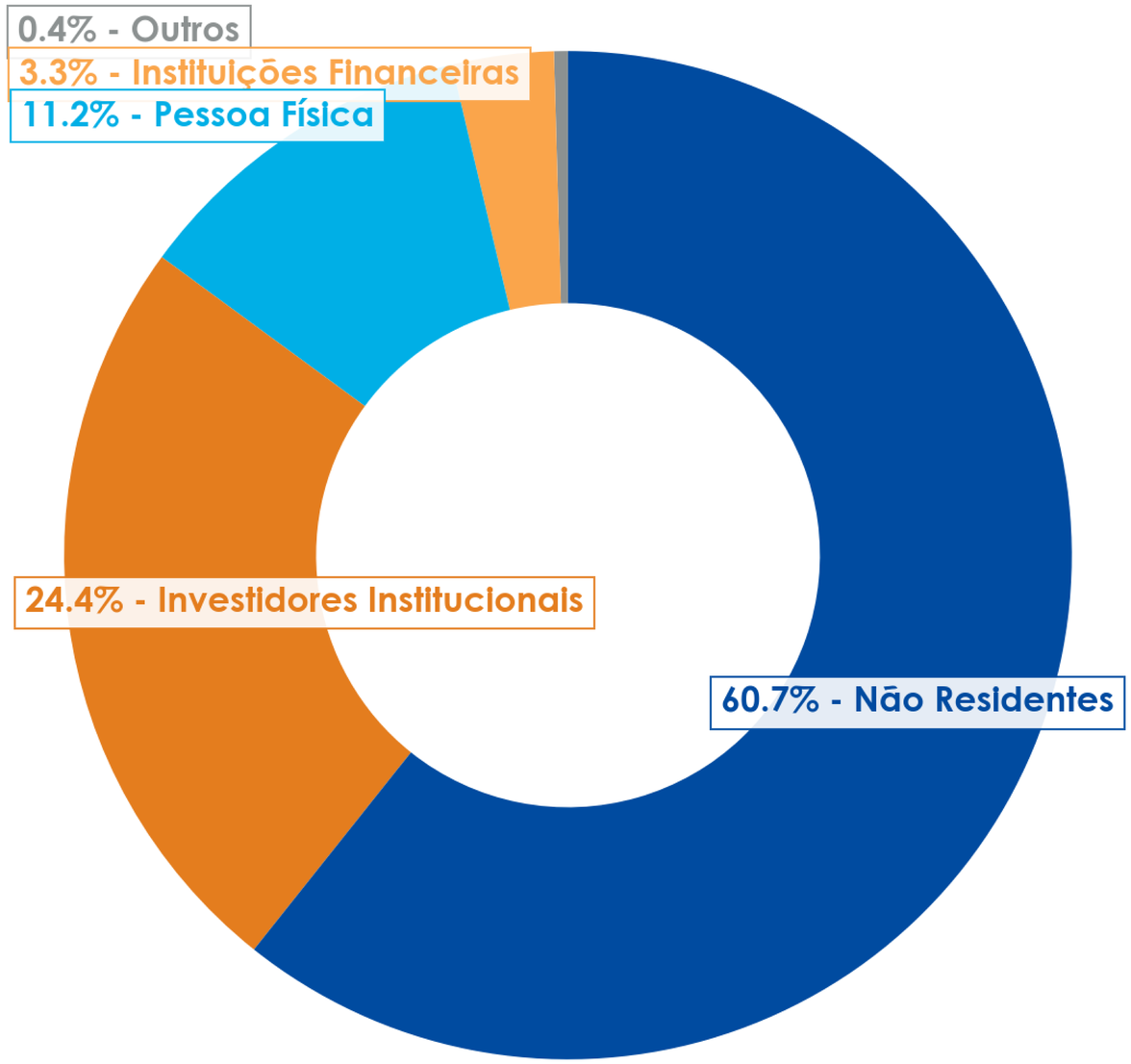


Composição ISE - TOP 15 Ativos

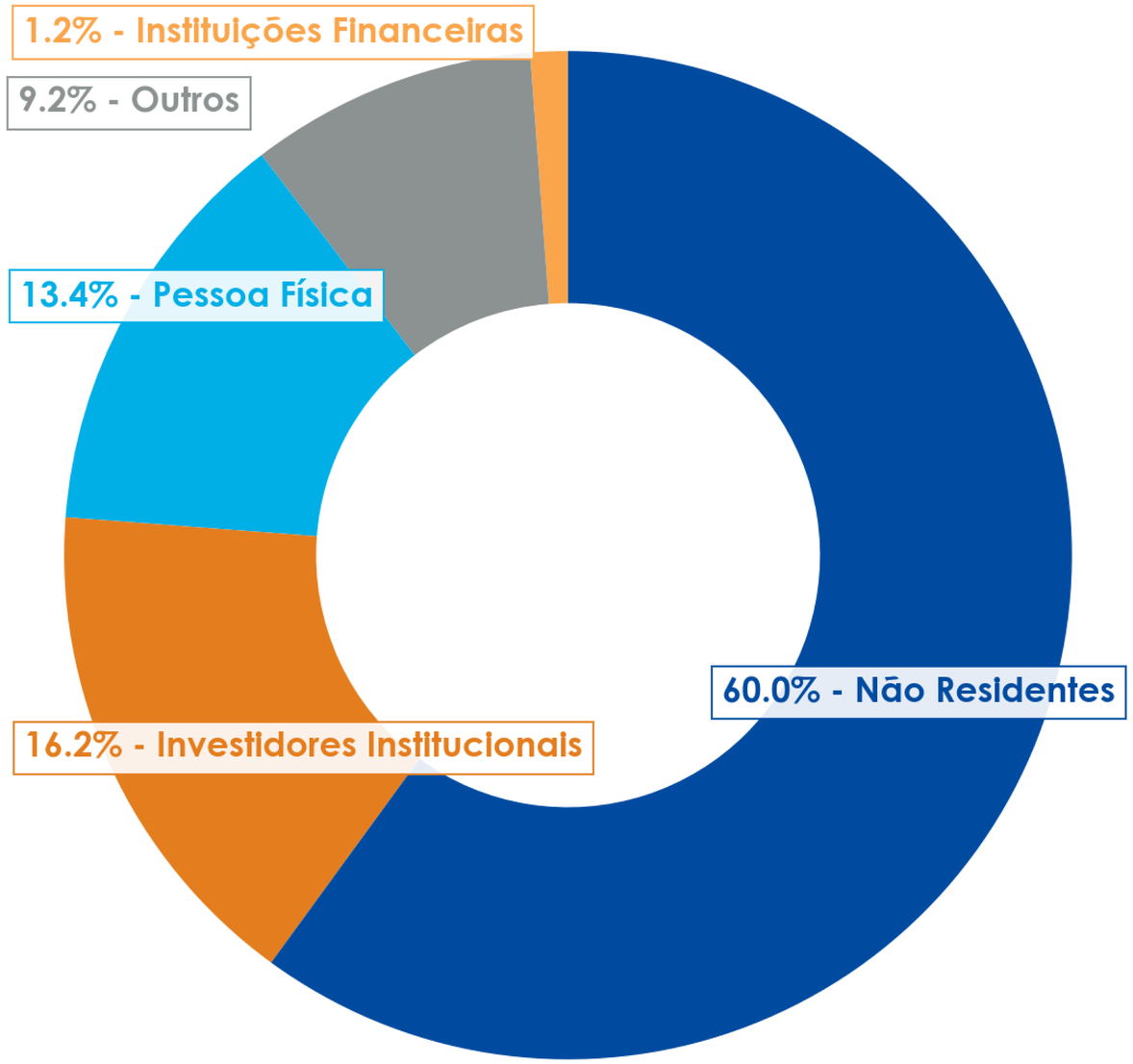
Ticker	Setor Econômico	% Mercado
BRFS3	Consumo Não Cíclico	4.00
NTCO3	Consumo Não Cíclico	2.82
BPAC11	Financeiro	2.75
SUZB3	Materiais Básicos	2.69
KLBN11	Materiais Básicos	2.67
VBBR3	Petróleo e Gás	2.56
LREN3	Consumo Cíclico	2.35
CSAN3	Petróleo e Gás	2.33
BBDC4	Financeiro	2.31
VIVT3	Comunicação	2.26
CPLE6	Utilidade Pública	2.26
ALSO3	Financeiro	2.25
TRPL4	Utilidade Pública	2.23
ITSA4	Financeiro	2.23
RDOR3	Saúde	2.20

Participação por Tipo Investidor*

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



Participação na posição em custódia (R$) – August/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	-7.38	-42.97	9.04	63.31	127.49	4.00
NTCO3	Consumo Não Cíclico	-16.91	5.27	15.18	56.42	89.74	2.82
BPAC11	Financeiro	-3.35	31.27	32.47	0.00	-	2.75
SUZB3	Materiais Básicos	4.33	17.40	50.15	27.76	83.16	2.69
KLBN11	Materiais Básicos	-0.01	29.29	22.76	24.69	86.60	2.67
VBBR3	Petróleo e Gás	7.76	5.07	18.46	39.61	114.28	2.56
LREN3	Consumo Cíclico	-14.51	-37.34	16.03	49.54	116.24	2.35
CSAN3	Petróleo e Gás	-12.14	-9.93	17.52	36.00	112.78	2.33
BBDC4	Financeiro	-10.16	-15.76	14.95	36.01	119.71	2.31
VIVT3	Comunicação	-1.23	6.80	41.35	22.94	105.18	2.26
CPLE6	Utilidade Pública	3.59	29.70	8.66	35.85	141.87	2.26
ALSO3	Financeiro	-6.33	33.23	22.77	33.95	92.96	2.25
TRPL4	Utilidade Pública	-0.72	9.40	24.92	17.30	101.53	2.23
ITSA4	Financeiro	-5.27	19.46	9.24	24.66	106.29	2.23
RDOR3	Saúde	-20.39	-13.45	28.66	45.73	111.29	2.20
BBAS3	Financeiro	-0.56	26.21	47.10	32.02	108.80	2.20

*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
B3SA3	Financeiro	-13.22	12.47	12.93	43.22	107.97	2.19
ITUB4	Financeiro	-4.17	11.52	27.43	27.13	103.20	2.16
TIMS3	Comunicação	0.49	30.15	14.41	23.92	92.82	2.15
RAIL3	Bens Industriais	-3.83	10.97	22.35	31.76	92.51	2.15
EGIE3	Utilidade Pública	-2.16	13.29	42.12	19.49	113.91	2.13
SANB11	Financeiro	-5.08	-2.07	27.11	28.00	93.36	2.09
ELET3	Utilidade Pública	-8.77	-23.03	35.26	33.59	90.69	2.08
RADL3	Saúde	-5.14	33.06	27.48	25.34	82.78	2.05
ENEV3	Utilidade Pública	-10.85	-23.10	11.92	32.28	91.26	2.05
CMIG4	Utilidade Pública	-2.68	12.45	12.33	30.51	108.58	1.98
CCRO3	Bens Industriais	-6.25	-7.31	12.46	30.16	92.74	1.93
HYPE3	Saúde	-9.87	-6.89	38.99	27.18	92.42	1.80
MGLU3	Consumo Cíclico	-17.61	-35.36	2.76	73.60	90.15	1.78
STBP3	Bens Industriais	-9.26	17.92	8.63	39.90	79.21	1.75
WEGE3	Bens Industriais	-10.12	28.78	35.88	28.40	80.43	1.67
CPFE3	Utilidade Pública	-2.38	6.64	34.15	27.41	103.83	1.65

*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
ASAI3	Consumo Não Cíclico	-13.81	-36.49	11.61	42.57	125.06	1.63
FLRY3	Saúde	-8.38	1.20	14.76	32.33	81.11	1.60
ABEV3	Consumo Não Cíclico	-6.86	-4.59	13.84	21.41	80.64	1.56
BRKM5	Materiais Básicos	-12.44	-26.96	22.24	54.35	119.06	1.52
COGN3	Consumo Cíclico	-12.84	17.74	2.92	50.51	86.25	1.36
VAMO3	Consumo Cíclico	-1.93	-15.10	11.71	47.17	94.80	1.31
AZUL4	Bens Industriais	-18.14	-12.13	14.49	82.13	122.24	1.25
SAPR11	Utilidade Pública	8.06	43.90	22.65	30.12	123.80	1.17
RAIZ4	Consumo Não Cíclico	-12.74	-19.44	3.63	45.56	99.02	1.14
ARZZ3	Consumo Cíclico	-14.24	-21.90	70.67	41.41	105.45	1.14
MRVE3	Consumo Cíclico	-18.27	12.36	11.36	56.16	106.28	1.13
SLCE3	Consumo Não Cíclico	-7.86	-2.41	40.22	28.11	66.72	1.10
CIEL3	Financeiro	-19.75	-28.24	3.72	38.08	70.30	1.05
NEOE3	Utilidade Pública	-6.70	18.27	18.24	27.63	104.62	0.92
USIM5	Materiais Básicos	-4.84	-10.06	6.88	38.79	78.40	0.91
AESB3	Utilidade Pública	-7.07	13.83	11.04	23.09	80.82	0.89

*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
DASA3	Saúde	-18.07	-47.16	11.02	67.42	142.66	0.84
MRFG3	Consumo Não Cíclico	0.43	-35.91	7.41	46.02	106.01	0.80
BPAN4	Financeiro	-5.91	24.20	8.75	44.14	68.53	0.78
MDIA3	Consumo Não Cíclico	-10.86	-11.53	37.20	40.97	94.47	0.67
ECOR3	Bens Industriais	-8.04	29.08	7.55	50.65	118.67	0.61
DXCO3	Materiais Básicos	-4.90	-6.88	7.96	47.76	115.17	0.59
SIMH3	Financeiro	-0.31	-6.66	9.75	51.01	104.74	0.58
BEEF3	Consumo Não Cíclico	-15.18	-42.35	8.40	46.08	115.32	0.57
VIIA3	Consumo Cíclico	-41.20	-60.56	1.27	67.27	93.42	0.53
GRND3	Consumo Cíclico	-9.20	7.75	6.81	32.70	84.63	0.48
MYPK3	Consumo Cíclico	0.29	6.44	13.89	37.90	92.62	0.47
MOVI3	Consumo Cíclico	8.76	-5.49	12.41	61.84	141.12	0.44
RANI3	Materiais Básicos	9.90	59.04	10.98	32.38	75.46	0.29
AMBP3	Utilidade Pública	-0.62	-23.12	20.91	52.29	93.04	0.24
PCAR3	Consumo Não Cíclico	-42.38	-45.01	4.94	54.33	120.36	0.21
CBAV3	Materiais Básicos	-19.25	-64.08	4.28	56.91	92.33	0.21

*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	-14.50	-31.91	6.25	66.52	116.09	0.14
GFSA3	Consumo Cíclico	-16.78	-51.85	5.01	124.90	210.34	0.06
AERI3	Bens Industriais	-20.83	-59.05	0.95	76.48	117.88	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