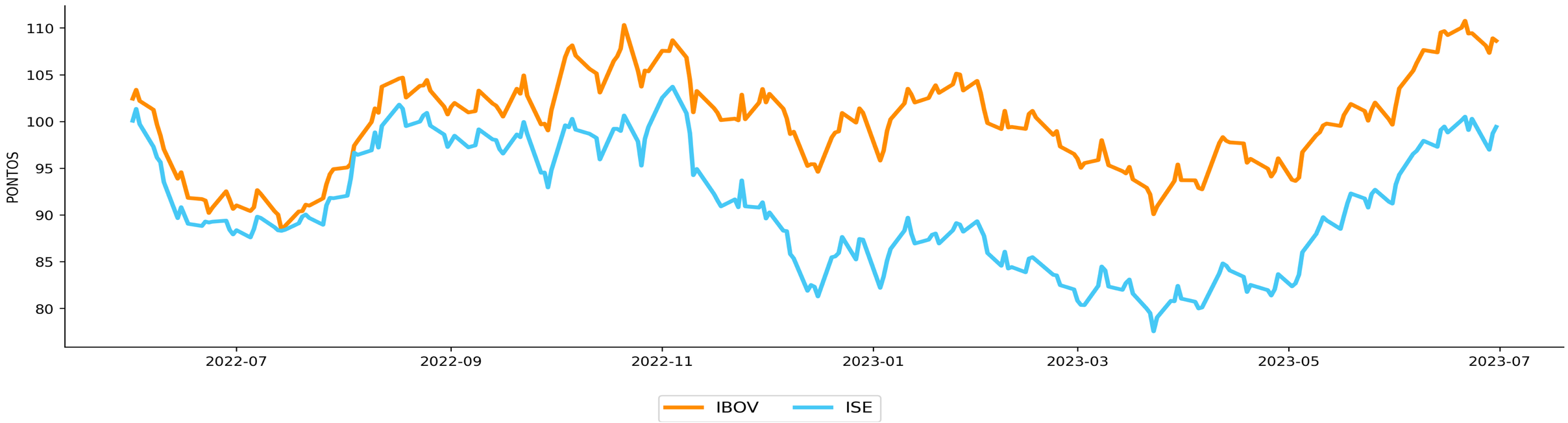
Boletim Mensal de ISE

June/2023

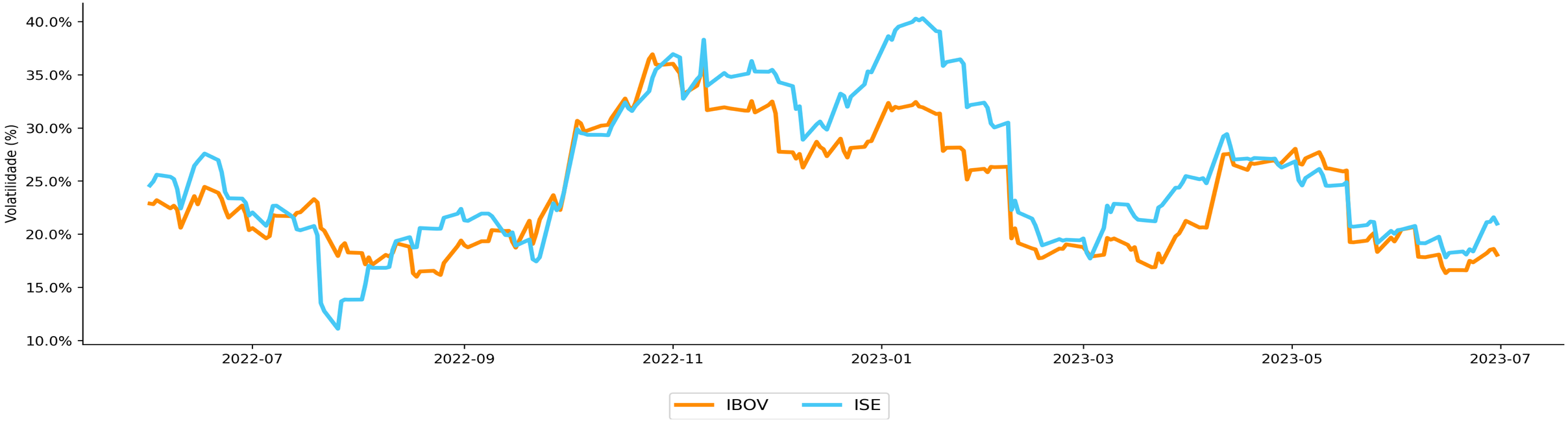
Comparativo ISE e Outros Indicadores



Indice	Variação MoM (%)	Variação YTD (%)	Variação 12M (%)	Variação Total (%)*
IGPTW B3	10.69	14.64	17.72	0.51
IBOV	9.00	13.36	19.83	8.62
IBRX 50	8.77	10.18	17.68	9.01
IBRX 100	8.87	12.02	17.60	9.08
ICO2	9.46	21.60	19.81	-9.34
IGC TRADE	9.04	13.15	18.86	10.37
IGC - NM	7.09	9.44	16.02	2.50
ISE	9.00	20.94	13.09	-0.58

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

Volatilidade ISE e Outros Indicadores

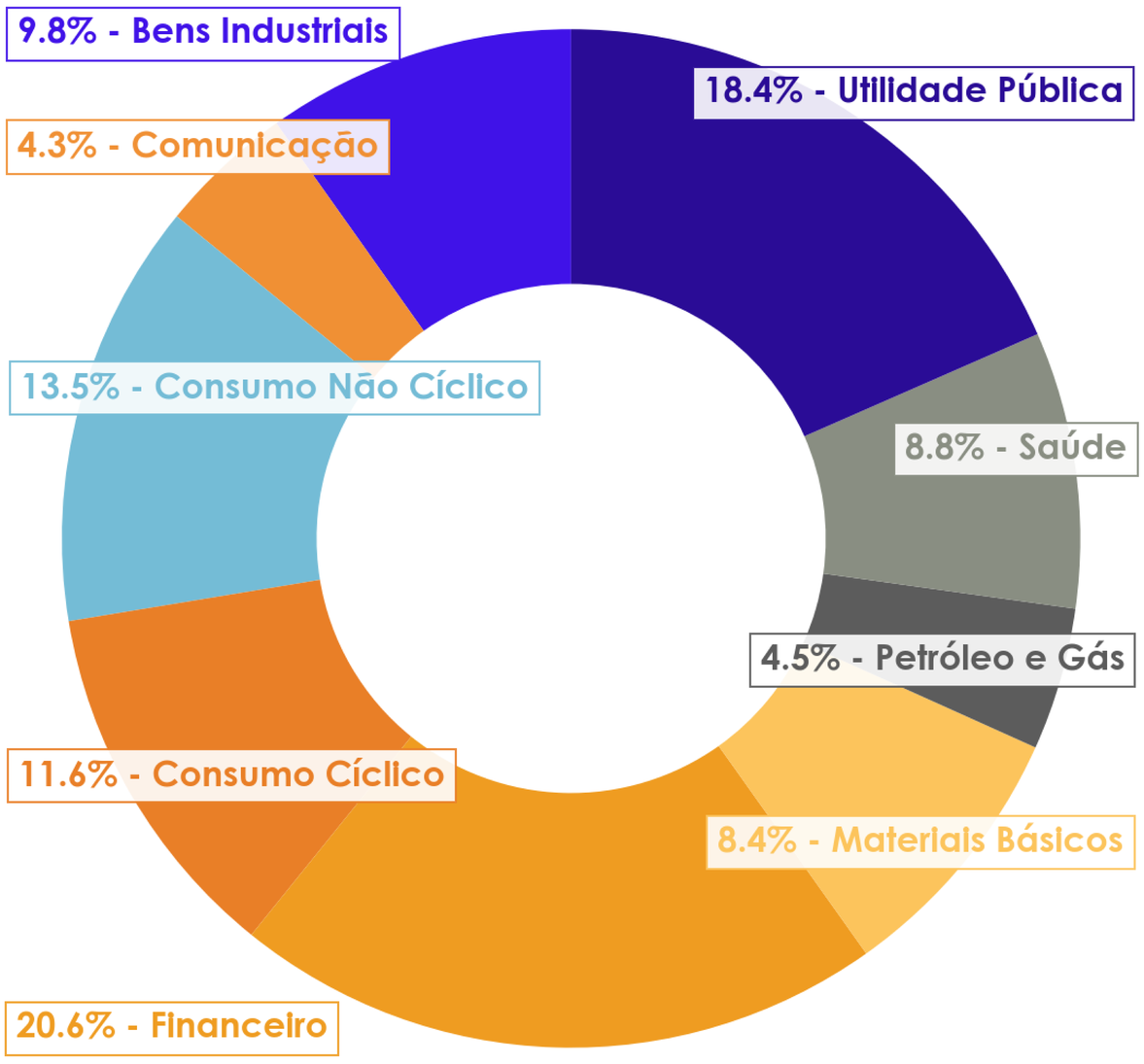


Variação Índice	Varição - Mês (%)*	Variação - Ano (%)**
IGPTW B3	24.76	12.16
IBOV	-6.47	-11.34
IBRX 50	-8.64	-19.31
IBRX 100	-6.58	-14.01
ICO2	2.99	-1.46
IGC TRADE	-7.23	-12.28
IGC - NM	-4.32	-17.66
ISE	4.79	-3.48

*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

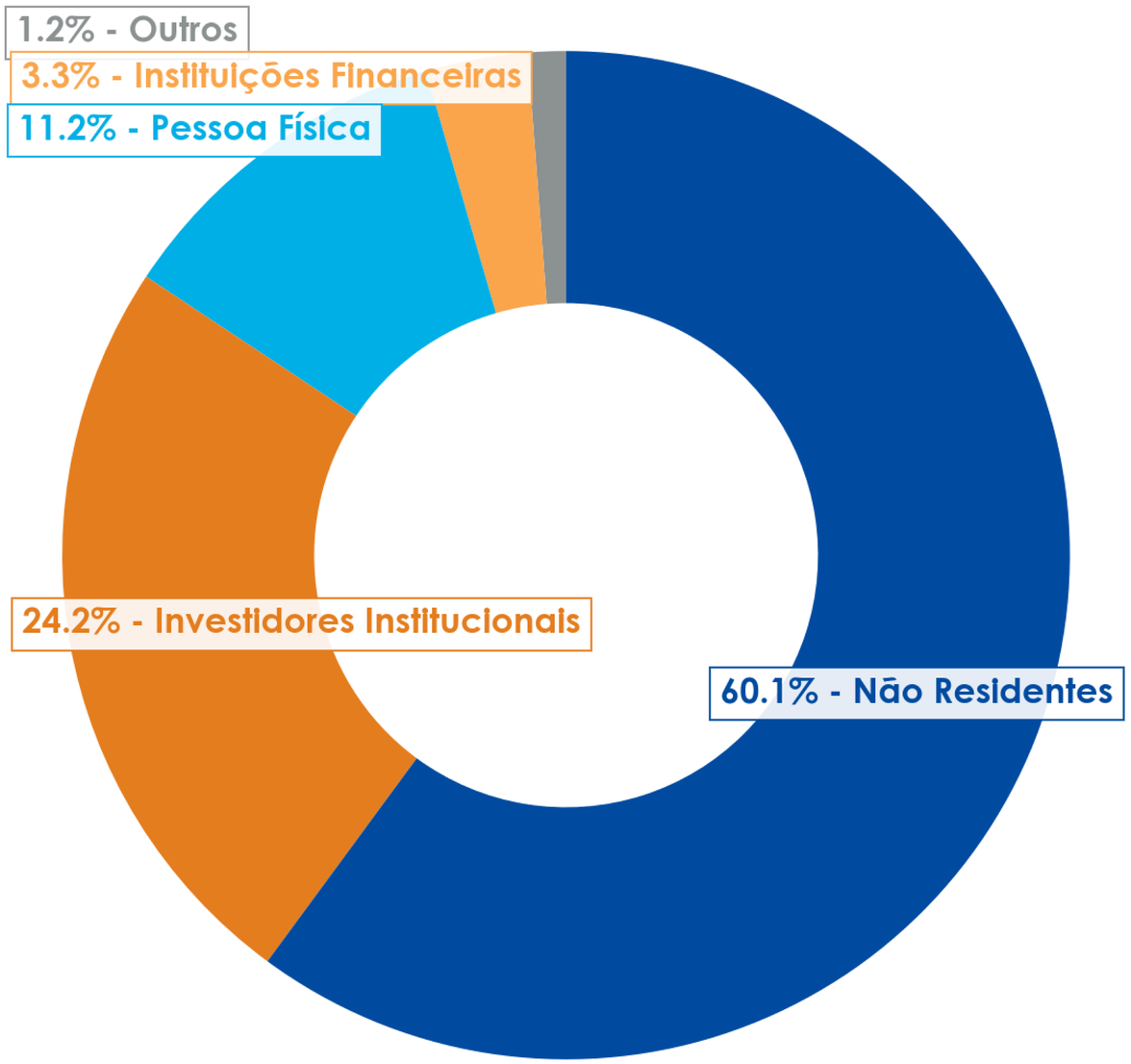


Composição ISE - TOP 15 Ativos

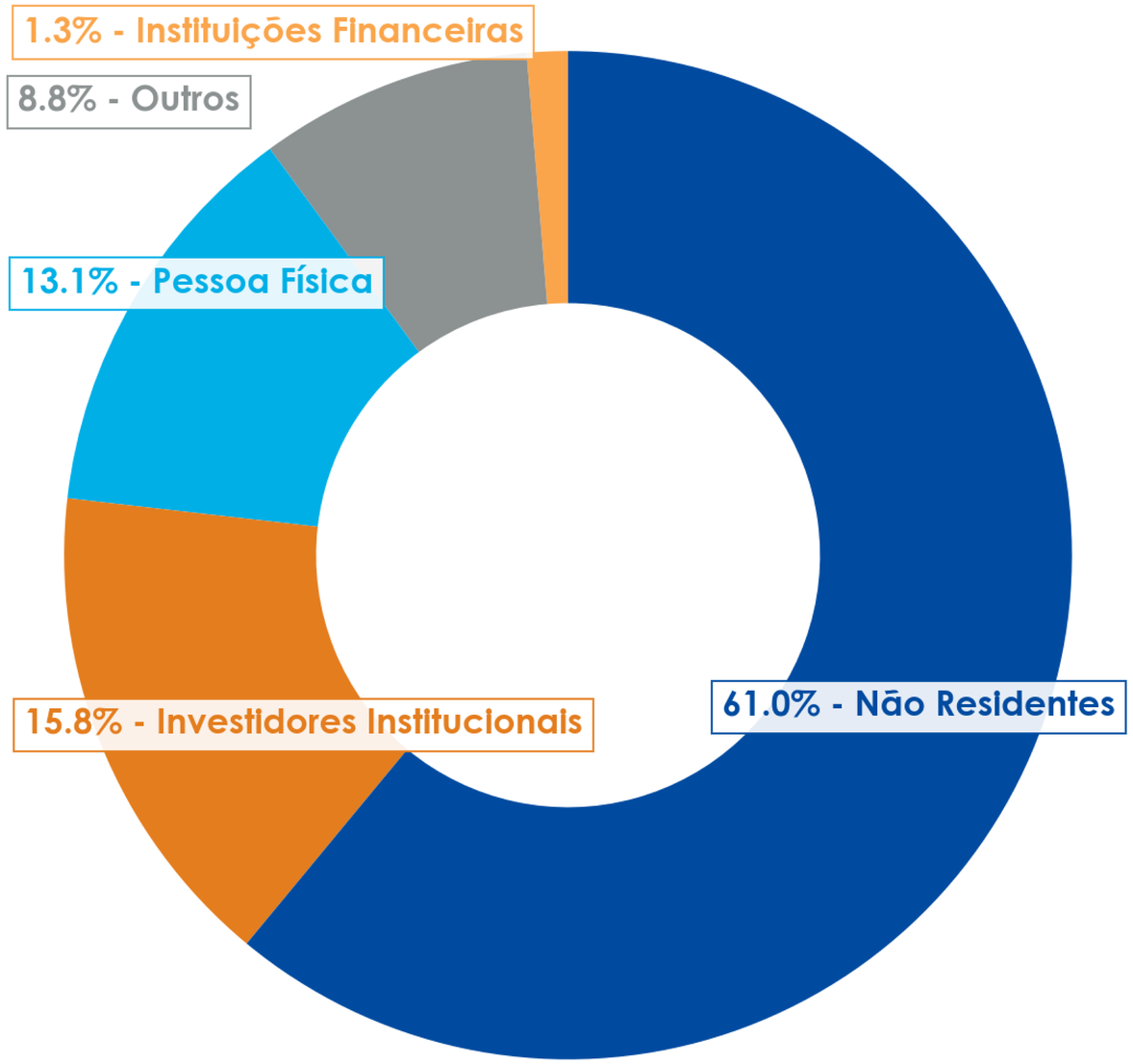
Ticker	Setor Econômico	% Mercado
NTCO3	Consumo Não Cíclico	2.97
LREN3	Consumo Cíclico	2.94
BPAC11	Financeiro	2.49
KLBN11	Materiais Básicos	2.41
RDOR3	Saúde	2.40
BBDC4	Financeiro	2.37
VBBR3	Petróleo e Gás	2.34
B3SA3	Financeiro	2.33
BRFS3	Consumo Não Cíclico	2.26
SANB11	Financeiro	2.24
SUZB3	Materiais Básicos	2.24
VIVT3	Comunicação	2.23
ALSO3	Financeiro	2.23
BBAS3	Financeiro	2.21
CSAN3	Petróleo e Gás	2.19

Participação por Tipo Investidor*

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



Participação na posição em custódia (R$) – June/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
NTCO3	Consumo Não Cíclico	20.52	24.74	16.74	62.20	110.87	2.97
LREN3	Consumo Cíclico	3.71	-8.51	20.00	49.54	121.57	2.94
BPAC11	Financeiro	19.58	45.13	31.45	0.00	-	2.49
KLBN11	Materiais Básicos	3.77	16.22	21.77	26.55	94.79	2.41
RDOR3	Saúde	13.52	14.76	32.92	48.77	129.23	2.40
BBDC4	Financeiro	7.47	2.16	16.45	35.35	116.44	2.37
VBBR3	Petróleo e Gás	12.18	12.88	18.05	39.59	115.69	2.34
B3SA3	Financeiro	10.59	37.40	14.61	45.23	114.27	2.33
BRFS3	Consumo Não Cíclico	9.59	-34.44	8.91	63.59	143.22	2.26
SANB11	Financeiro	7.10	12.96	30.63	28.04	93.09	2.24
SUZB3	Materiais Básicos	-1.25	-7.79	44.22	29.66	91.04	2.24
VIVT3	Comunicação	8.70	-2.27	43.27	22.70	105.04	2.23
ALSO3	Financeiro	13.75	58.38	24.65	34.80	95.53	2.23
BBAS3	Financeiro	13.45	65.64	49.40	32.99	115.19	2.21
CSAN3	Petróleo e Gás	19.07	0.80	17.86	36.89	117.30	2.19
EGIE3	Utilidade Pública	8.71	19.78	45.69	19.52	112.44	2.18

*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
TRPL4	Utilidade Pública	3.93	15.60	25.36	18.34	101.95	2.15
ITSA4	Financeiro	11.39	35.96	9.64	24.55	103.67	2.15
ITUB4	Financeiro	9.01	33.08	28.42	26.99	101.31	2.14
ELET3	Utilidade Pública	12.61	-13.40	39.75	31.92	84.92	2.13
RADL3	Saúde	4.48	62.48	29.60	26.70	87.31	2.05
TIMS3	Comunicação	5.59	22.43	14.62	24.03	92.53	2.04
MGLU3	Consumo Cíclico	-11.32	44.02	3.37	82.58	116.51	2.02
CCRO3	Bens Industriais	3.54	15.03	14.05	31.32	95.31	2.01
RAIL3	Bens Industriais	6.63	39.49	22.20	32.02	93.68	1.99
CPLE6	Utilidade Pública	11.73	26.70	8.29	35.95	138.11	1.98
HYPE3	Saúde	12.71	23.58	46.01	29.12	99.01	1.96
ENEV3	Utilidade Pública	7.16	-16.93	12.27	32.32	89.68	1.95
STBP3	Bens Industriais	2.11	68.99	10.16	42.27	82.54	1.93
CMIG4	Utilidade Pública	11.59	36.72	12.86	31.66	112.55	1.91
BRKM5	Materiais Básicos	24.04	-25.19	27.86	54.74	118.43	1.87
ASAI3	Consumo Não Cíclico	27.91	-3.07	13.75	42.08	124.50	1.77

*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
AZUL4	Bens Industriais	29.73	76.58	21.86	84.09	135.67	1.70
FLRY3	Saúde	8.10	6.40	16.05	34.54	89.20	1.63
WEGE3	Bens Industriais	0.53	45.12	37.75	28.51	78.52	1.63
ABEV3	Consumo Não Cíclico	6.94	21.06	15.41	22.67	84.72	1.61
CPFE3	Utilidade Pública	13.57	18.91	34.39	29.25	108.61	1.55
COGN3	Consumo Cíclico	12.80	52.34	3.26	52.03	91.68	1.44
ENBR3	Utilidade Pública	2.70	23.52	23.62	24.71	122.57	1.41
RAIZ4	Consumo Não Cíclico	21.21	2.38	4.40	49.23	114.59	1.34
CIEL3	Financeiro	-1.71	29.59	4.59	39.83	76.29	1.24
ARZZ3	Consumo Cíclico	7.18	15.90	79.07	41.78	112.86	1.15
SAPR11	Utilidade Pública	7.95	30.06	21.86	30.46	125.20	1.06
SLCE3	Consumo Não Cíclico	10.69	2.13	38.22	30.87	74.53	0.97
NEOE3	Utilidade Pública	31.70	51.73	21.23	28.15	114.06	0.95
AESB3	Utilidade Pública	0.57	16.76	12.25	23.41	81.12	0.94
VAMO3	Consumo Cíclico	-5.91	5.79	12.11	49.43	99.80	0.92
USIM5	Materiais Básicos	0.71	-14.31	7.07	42.38	86.17	0.90

*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
VIIA3	Consumo Cíclico	-9.66	11.98	2.15	75.68	119.22	0.86
MRVE3	Consumo Cíclico	14.78	50.48	11.57	60.66	129.95	0.83
BPAN4	Financeiro	40.12	56.02	9.15	48.11	75.59	0.76
DASA3	Saúde	9.94	-22.09	11.83	63.28	137.51	0.73
MDIA3	Consumo Não Cíclico	10.45	63.96	42.57	47.66	136.68	0.71
PCAR3	Consumo Não Cíclico	14.93	14.50	18.71	49.60	117.15	0.70
BEEF3	Consumo Não Cíclico	4.01	-15.35	10.63	43.45	103.04	0.66
DXCO3	Materiais Básicos	-5.65	-2.61	8.35	48.98	125.27	0.55
MRFG3	Consumo Não Cíclico	9.49	-28.62	7.27	46.19	114.13	0.51
ECOR3	Bens Industriais	1.56	14.25	6.50	51.06	123.72	0.50
SIMH3	Financeiro	-2.71	-0.77	8.99	51.61	105.61	0.49
GRND3	Consumo Cíclico	7.47	28.77	7.48	34.64	89.37	0.49
MYPK3	Consumo Cíclico	-3.18	-15.89	12.49	39.61	95.35	0.39
MOVI3	Consumo Cíclico	3.13	-14.61	10.53	60.94	139.45	0.33
CBAV3	Materiais Básicos	-3.08	-53.06	5.04	57.70	94.42	0.23
RANI3	Materiais Básicos	11.42	52.04	9.27	33.88	79.55	0.23

*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
AMBP3	Utilidade Pública	4.51	-1.84	21.78	53.27	91.36	0.22
GUAR3	Consumo Cíclico	66.02	14.12	7.72	68.54	133.19	0.16
GFSA3	Consumo Cíclico	40.08	-26.03	6.92	126.53	239.01	0.08
AERI3	Bens Industriais	-10.74	-52.50	1.33	82.20	139.06	0.07

*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