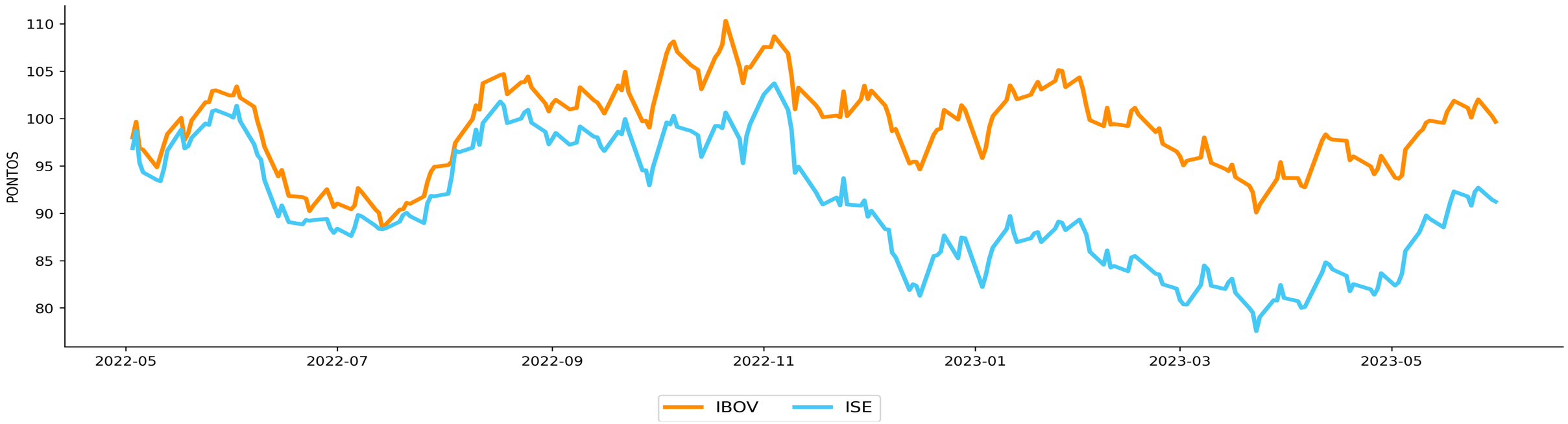
Boletim Mensal de ISE

May/2023

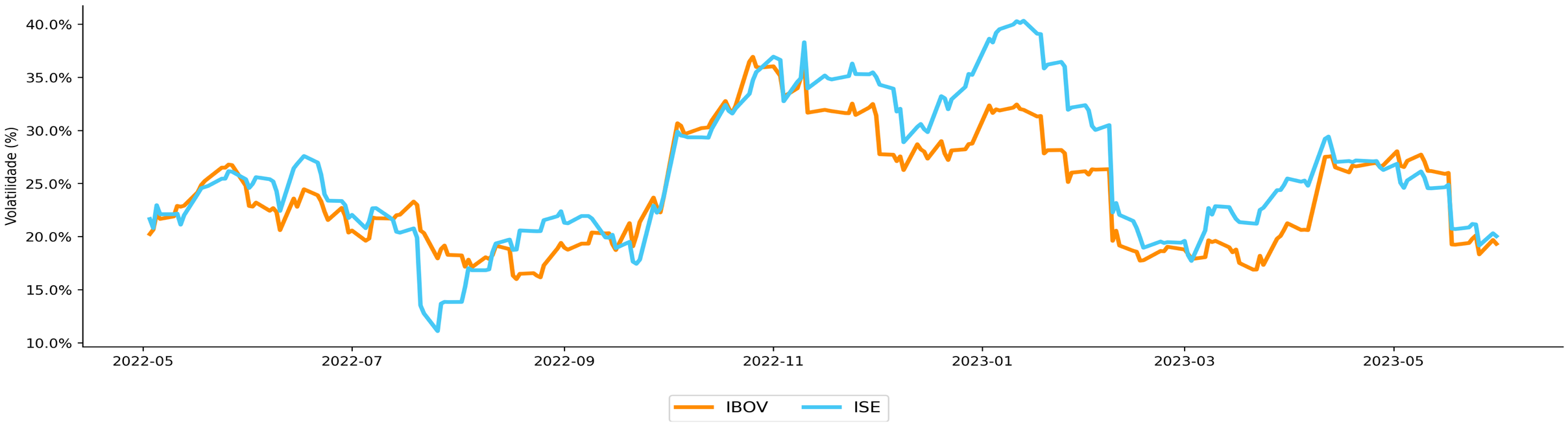
Comparativo ISE e Outros Indicadores



Indice	Variação MoM (%)	Variação YTD (%)	Variação 12M (%)	Variação Total (%)*
IGPTW B3	9.38	3.57	-9.77	-9.20
IBOV	3.74	4.00	-2.71	-0.35
IBRX 50	2.92	1.29	-4.44	0.21
IBRX 100	3.59	2.89	-4.47	0.20
ICO2	7.16	11.09	-3.33	-17.18
IGC TRADE	4.20	3.77	-3.89	1.22
IGC - NM	4.41	2.20	-5.02	-4.28
ISE	9.02	10.96	-9.06	-8.79

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

Volatilidade ISE e Outros Indicadores

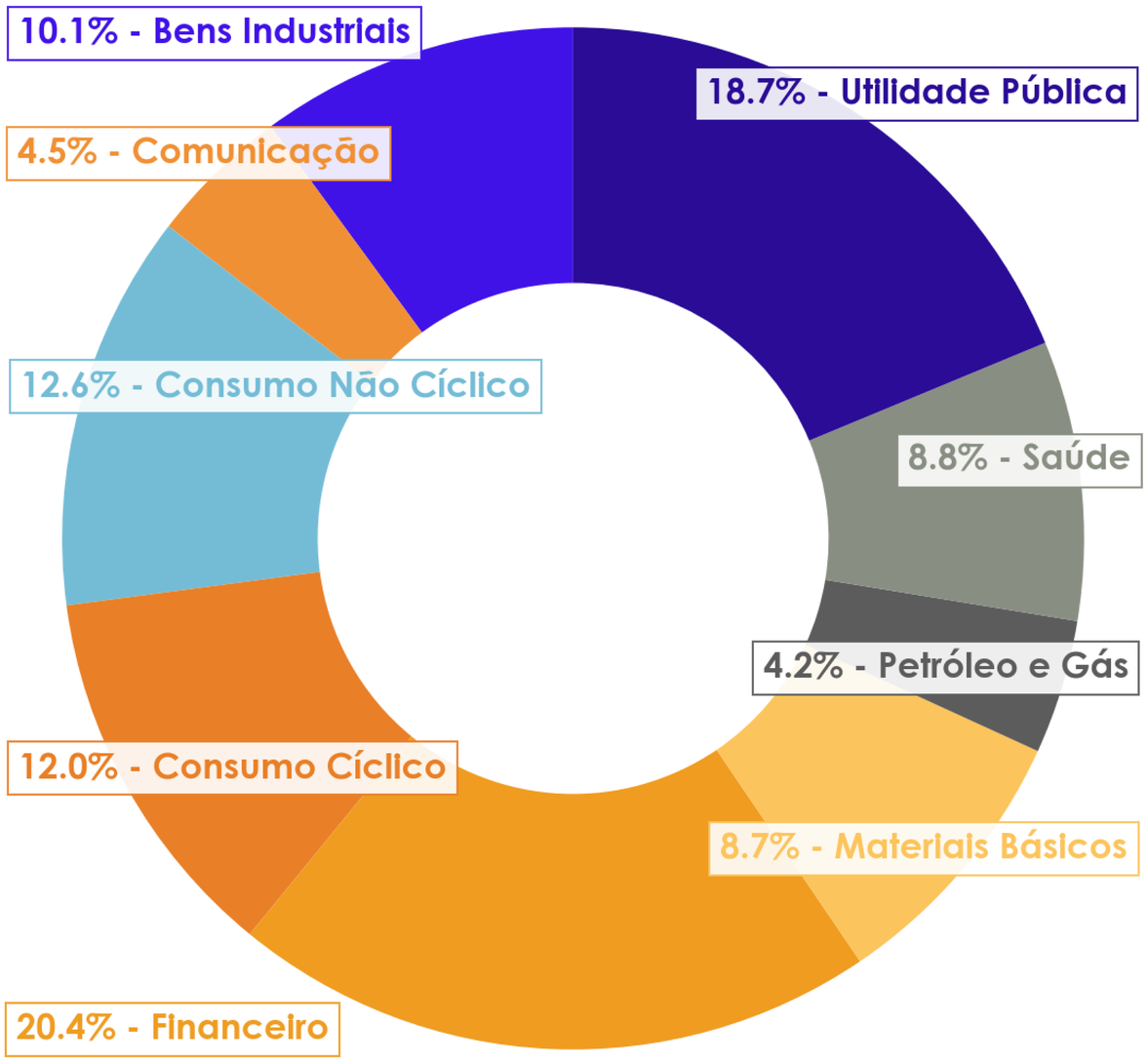


Variação Índice	Varição - Mês (%)*	Variação - Ano (%)**
IGPTW B3	-25.84	-20.50
IBOV	-27.70	-22.07
IBRX 50	-29.11	-23.46
IBRX 100	-28.12	-22.88
ICO2	-27.22	-28.69
IGC TRADE	-26.66	-20.17
IGC - NM	-27.35	-25.46
ISE	-23.73	-21.12

*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

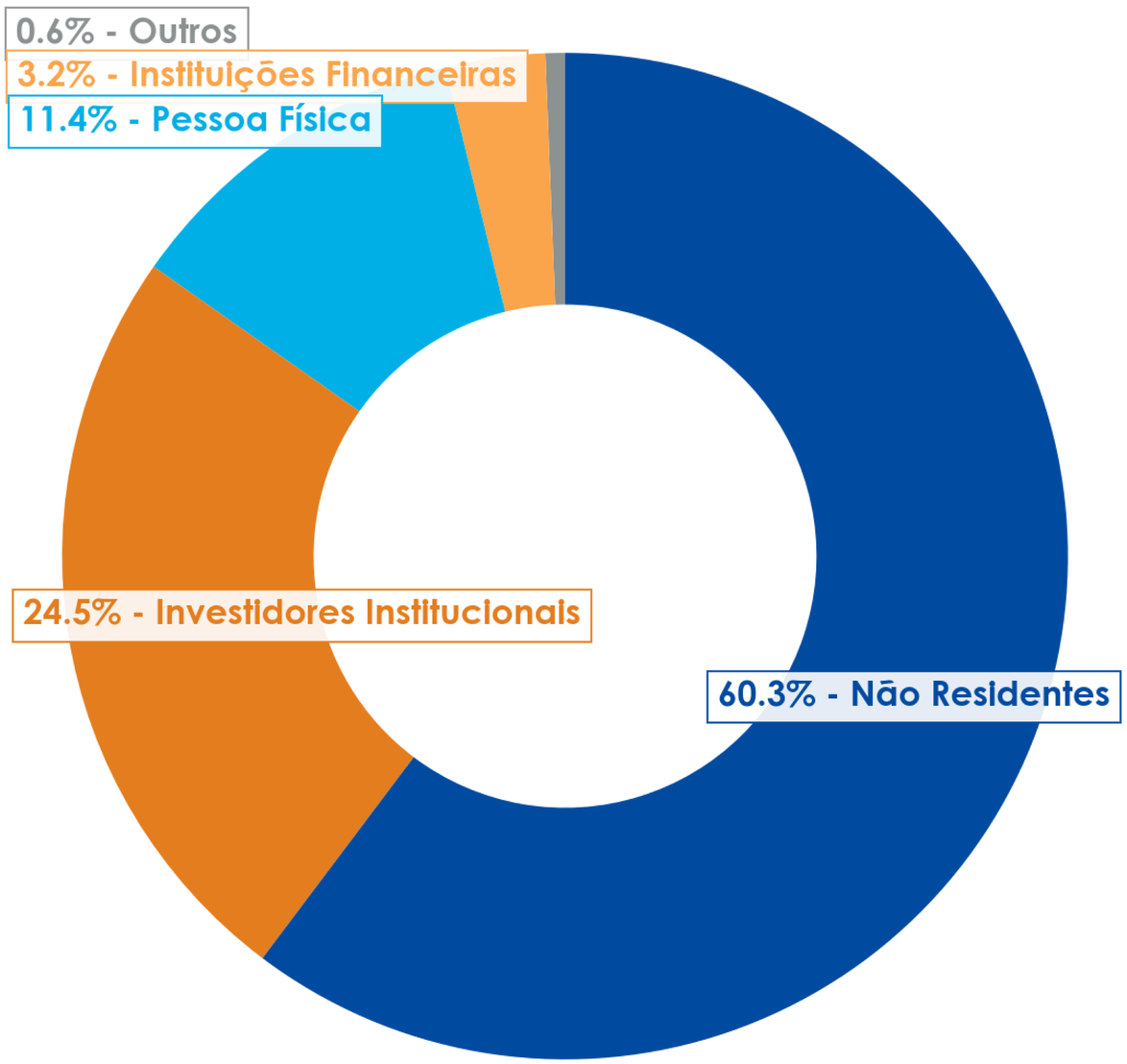


Composição ISE - TOP 15 Ativos

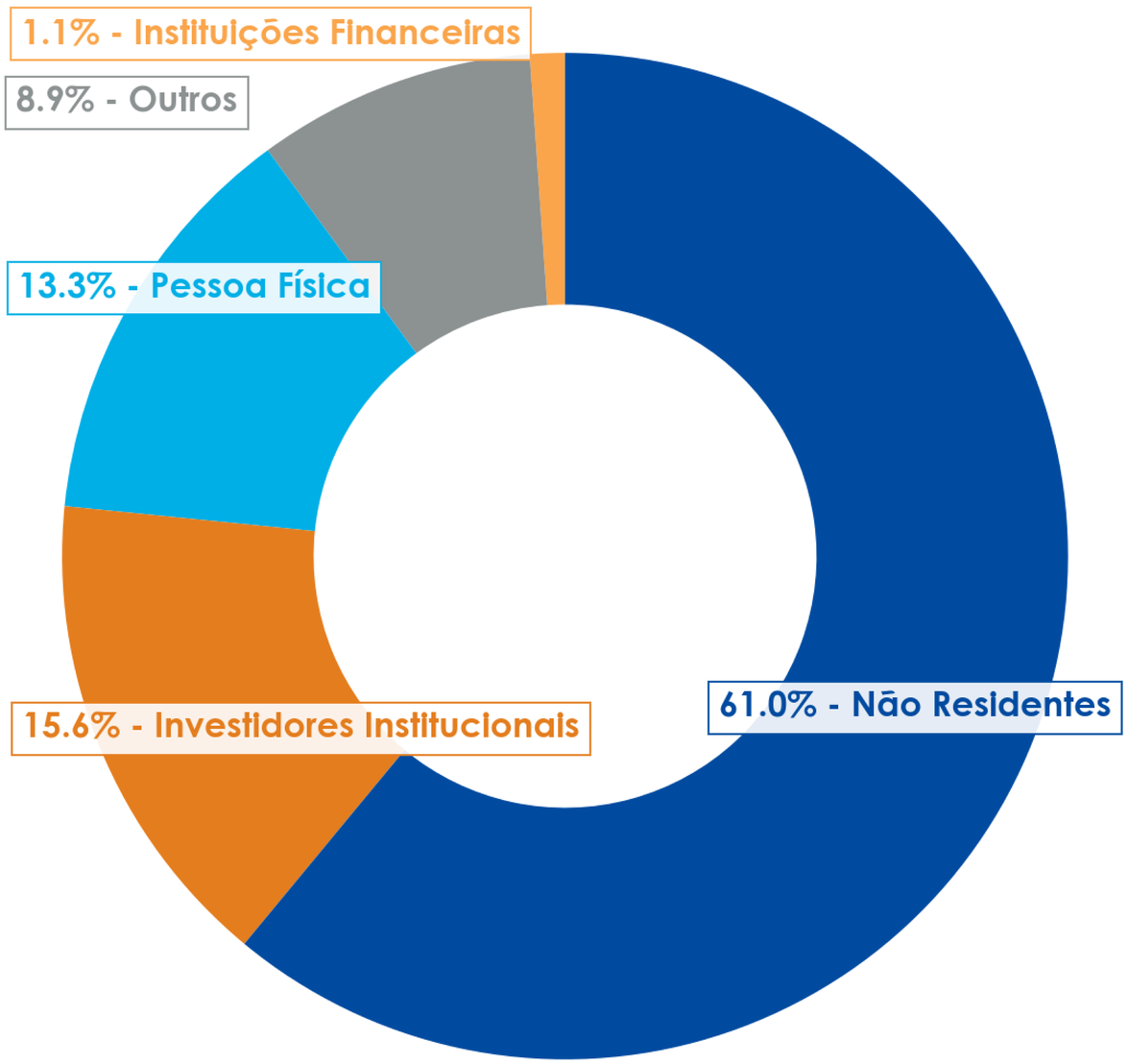
Ticker	Setor Econômico	% Mercado
LREN3	Consumo Cíclico	2.86
NTCO3	Consumo Não Cíclico	2.63
KLBN11	Materiais Básicos	2.56
BBDC4	Financeiro	2.48
SUZB3	Materiais Básicos	2.47
MGLU3	Consumo Cíclico	2.35
TRPL4	Utilidade Pública	2.32
RDOR3	Saúde	2.31
BPAC11	Financeiro	2.31
VIVT3	Comunicação	2.29
B3SA3	Financeiro	2.29
SANB11	Financeiro	2.27
VBBR3	Petróleo e Gás	2.24
EGIE3	Utilidade Pública	2.23
RADL3	Saúde	2.19

Participação por Tipo Investidor*

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



Participação na posição em custódia (R$) – May/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
LREN3	Consumo Cíclico	22.79	-24.44	19.45	48.73	123.18	2.86
NTCO3	Consumo Não Cíclico	25.59	-15.66	13.89	63.92	118.44	2.63
KLBN11	Materiais Básicos	11.65	1.27	20.98	26.48	94.13	2.56
BBDC4	Financeiro	12.14	-19.33	15.51	35.48	116.90	2.48
SUZB3	Materiais Básicos	12.51	-13.27	44.78	30.18	93.64	2.47
MGLU3	Consumo Cíclico	13.77	2.15	3.80	83.92	121.31	2.35
TRPL4	Utilidade Pública	5.86	5.22	24.40	18.02	98.85	2.32
RDOR3	Saúde	26.80	-18.21	29.00	49.26	133.17	2.31
BPAC11	Financeiro	12.30	6.85	26.30	0.00	-	2.31
VIVT3	Comunicação	-2.72	-17.12	40.00	22.59	104.73	2.29
B3SA3	Financeiro	14.04	7.89	13.32	44.44	111.71	2.29
SANB11	Financeiro	6.44	-9.43	28.60	28.00	91.53	2.27
VBBR3	Petróleo e Gás	21.89	-13.51	16.09	39.09	112.39	2.24
EGIE3	Utilidade Pública	6.30	3.66	42.03	19.68	114.29	2.23
RADL3	Saúde	12.11	44.59	28.33	27.61	90.94	2.19
TIMS3	Comunicação	-0.29	3.67	13.96	24.05	91.58	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
CCRO3	Bens Industriais	0.00	4.36	13.57	31.81	97.28	2.15
ITUB4	Financeiro	1.65	5.87	26.33	27.61	102.75	2.15
ITSA4	Financeiro	1.15	6.41	8.78	25.05	105.12	2.14
ALSO3	Financeiro	19.59	15.44	21.67	34.87	94.68	2.14
BBAS3	Financeiro	4.11	34.08	44.62	32.59	113.12	2.13
ELET3	Utilidade Pública	4.28	-15.69	35.30	32.07	84.93	2.07
STBP3	Bens Industriais	17.82	48.22	9.95	42.60	84.57	2.06
BRFS3	Consumo Não Cíclico	28.23	-48.05	8.13	64.04	146.11	2.05
RAIL3	Bens Industriais	5.69	18.16	20.82	31.49	91.97	2.04
ENEV3	Utilidade Pública	0.88	-26.51	11.45	32.19	91.79	2.02
CPLE6	Utilidade Pública	-7.48	5.10	7.42	35.40	136.26	2.00
CSAN3	Petróleo e Gás	2.85	-28.70	15.00	36.59	117.69	2.00
CMIG4	Utilidade Pública	-5.26	10.84	11.70	31.15	110.38	1.94
HYPE3	Saúde	9.58	8.38	40.82	30.15	106.88	1.93
WEGE3	Bens Industriais	-8.54	50.75	37.61	30.73	87.98	1.83
FLRY3	Saúde	7.37	5.69	15.59	38.12	111.59	1.68

*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	1.77	6.90	14.41	22.71	80.50	1.65
ASAI3	Consumo Não Cíclico	-12.53	-31.73	10.75	37.99	117.65	1.60
BRKM5	Materiais Básicos	13.49	-49.53	22.46	54.27	114.28	1.58
CPFE3	Utilidade Pública	-2.44	-4.06	30.28	29.84	118.08	1.53
ENBR3	Utilidade Pública	2.22	14.95	23.00	25.13	122.77	1.48
AZUL4	Bens Industriais	55.16	-16.21	16.85	84.48	140.43	1.38
CIEL3	Financeiro	-13.36	25.18	4.67	40.07	76.67	1.37
COGN3	Consumo Cíclico	41.67	9.06	2.89	52.07	91.10	1.36
ARZZ3	Consumo Cíclico	11.13	-6.23	73.77	41.73	114.08	1.18
RAIZ4	Consumo Não Cíclico	13.79	-36.76	3.63	49.28	113.29	1.13
SAPR11	Utilidade Pública	6.58	9.49	20.25	30.13	124.25	1.09
VAMO3	Consumo Cíclico	5.48	-12.63	12.87	48.99	100.99	1.06
AESB3	Utilidade Pública	14.04	13.53	12.18	23.49	81.31	1.02
SLCE3	Consumo Não Cíclico	-7.10	-25.77	34.53	32.43	81.75	0.96
VIIA3	Consumo Cíclico	29.35	-24.20	2.38	76.28	121.08	0.96
USIM5	Materiais Básicos	-2.50	-32.85	7.02	44.49	93.35	0.95

*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
NEOE3	Utilidade Pública	4.34	-4.08	16.12	26.55	112.12	0.81
MRVE3	Consumo Cíclico	40.00	8.64	10.08	59.54	130.34	0.79
DASA3	Saúde	27.34	-42.37	10.76	61.96	133.82	0.72
MDIA3	Consumo Não Cíclico	34.93	49.84	38.59	48.02	136.97	0.71
BEEF3	Consumo Não Cíclico	19.53	-24.05	10.22	43.50	105.87	0.67
PCAR3	Consumo Não Cíclico	8.53	-19.53	16.28	48.31	113.70	0.67
DXCO3	Materiais Básicos	50.25	-9.12	8.85	49.15	125.48	0.62
BPAN4	Financeiro	21.83	-14.75	6.53	46.47	71.39	0.59
SIMH3	Financeiro	20.80	-20.60	9.24	51.86	108.24	0.53
ECOR3	Bens Industriais	3.73	-13.00	6.40	51.43	125.96	0.52
GRND3	Consumo Cíclico	1.29	-1.49	6.96	35.33	92.68	0.49
MRFG3	Consumo Não Cíclico	2.00	-49.49	6.64	46.56	119.02	0.48
MYPK3	Consumo Cíclico	13.66	-8.41	12.90	41.20	100.96	0.43
MOVI3	Consumo Cíclico	20.24	-39.54	10.21	59.41	138.32	0.36
CBAV3	Materiais Básicos	-1.52	-65.78	5.20	59.42	98.57	0.27
AMBP3	Utilidade Pública	2.31	-30.21	20.84	53.80	92.49	0.24

*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
RANI3	Materiais Básicos	-3.16	22.50	8.32	33.35	76.40	0.22
GUAR3	Consumo Cíclico	9.93	-45.91	4.65	66.65	130.79	0.10
AERI3	Bens Industriais	-5.10	-58.15	1.49	82.64	143.22	0.09
GFSA3	Consumo Cíclico	-13.79	-61.03	4.94	121.21	232.16	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