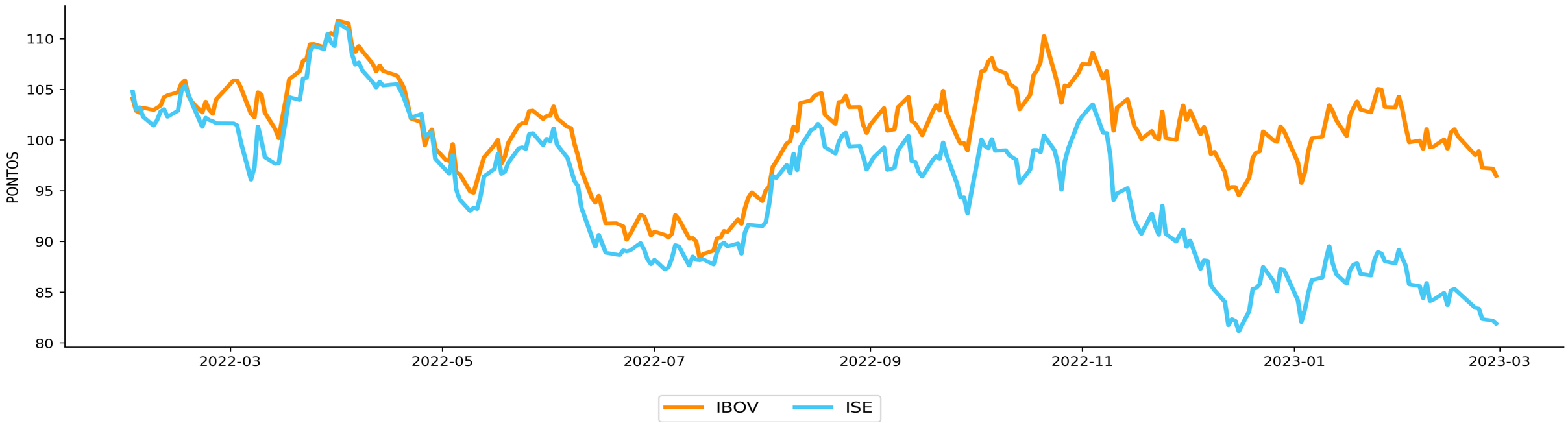
Boletim Mensal de ISE

February/2023

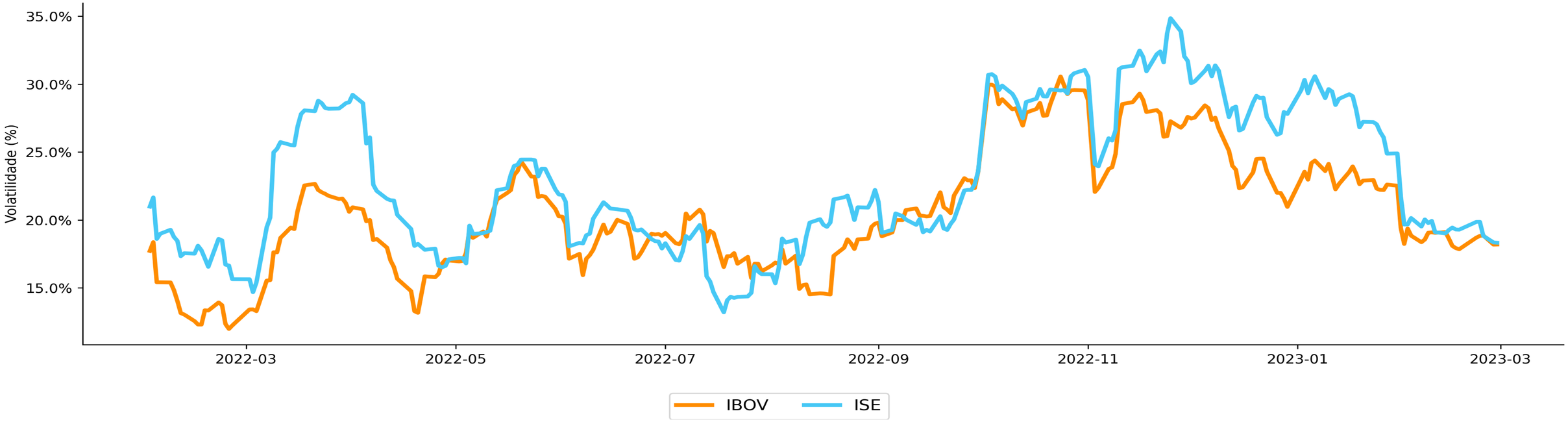
Comparativo ISE e Outros Indicadores



Indice	Variação MoM (%)	Variação YTD (%)	Variação 12M (%)	Variação Total (%)*
IGPTW B3	-11.01	-6.10	-20.13	-16.36
IBOV	-7.49	-1.36	-7.26	-3.54
IBRX 50	-7.54	-1.62	-7.74	-0.75
IBRX 100	-7.59	-1.50	-8.23	-2.28
ICO2	-6.95	-1.60	-13.10	-24.71
IGC TRADE	-7.66	-1.39	-8.15	-2.01
IGC - NM	-8.49	-1.29	-11.44	-5.97
ISE	-8.16	-2.72	-19.45	-18.12

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

Volatilidade ISE e Outros Indicadores

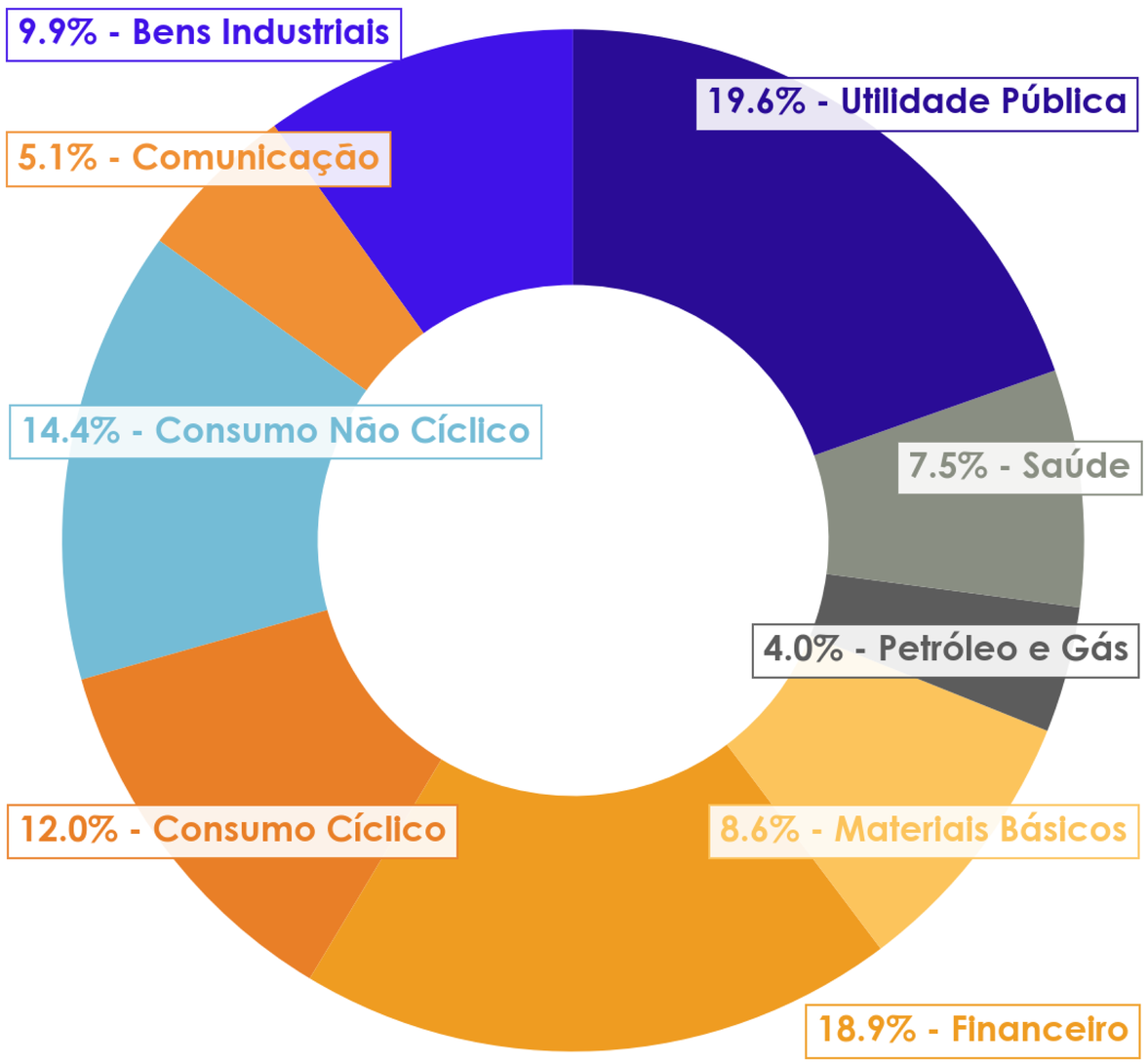


Variação Índice	Varição - Mês (%)*	Variação - Ano (%)**
IGPTW B3	-13.86	2.05
IBOV	-6.32	48.66
IBRX 50	-4.86	24.94
IBRX 100	-5.69	41.92
ICO2	-10.71	44.53
IGC TRADE	-6.21	44.57
IGC - NM	-11.99	9.26
ISE	-15.67	17.19

*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

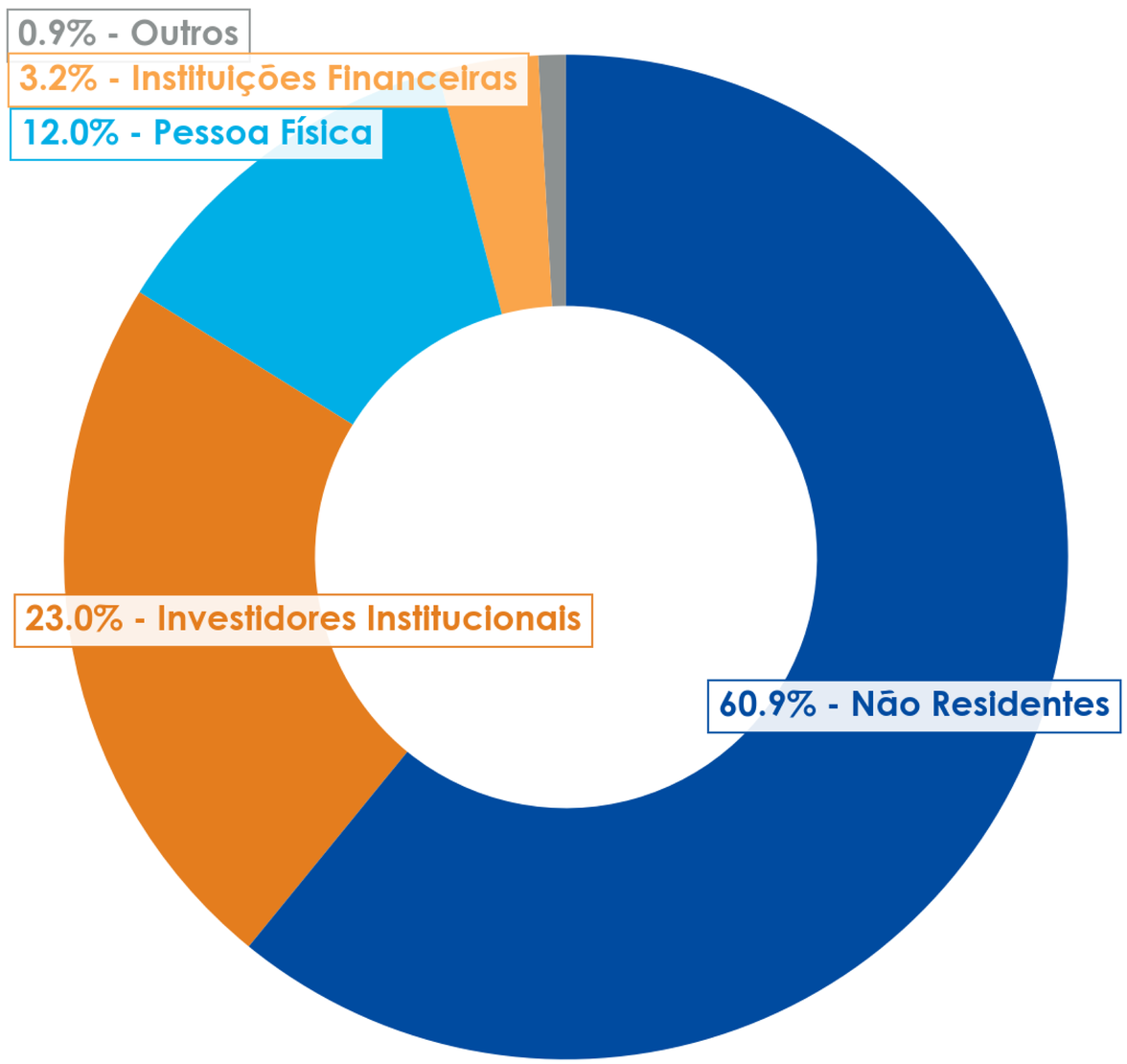


Composição ISE - TOP 15 Ativos

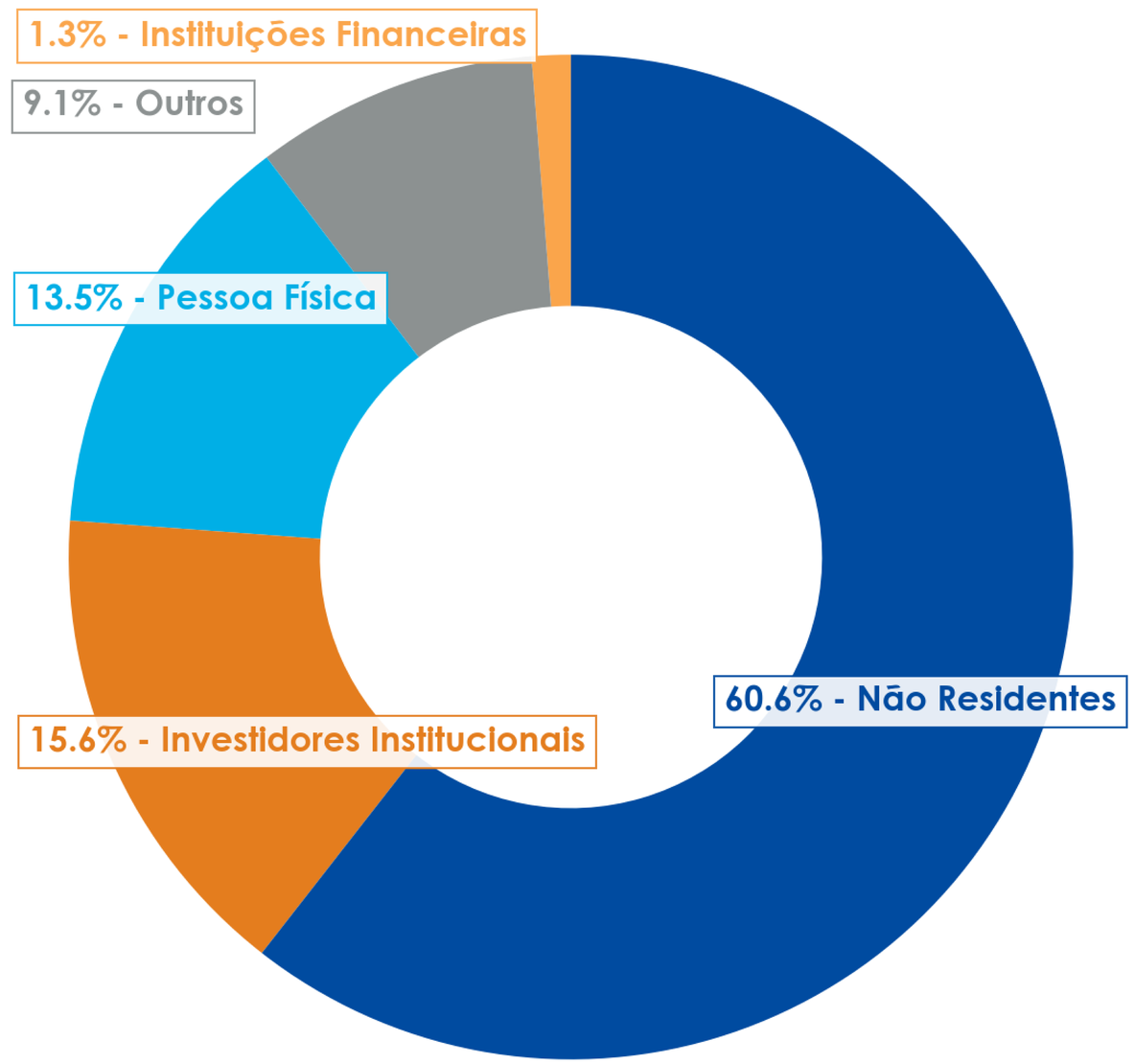
Ticker	Setor Econômico	% Mercado
NTCO3	Consumo Não Cíclico	3.19
MGLU3	Consumo Cíclico	3.06
BBAS3	Financeiro	2.70
VIVT3	Comunicação	2.68
EGIE3	Utilidade Pública	2.50
CCRO3	Bens Industriais	2.44
KLBN11	Materiais Básicos	2.43
SANB11	Financeiro	2.43
ITUB4	Financeiro	2.40
TIMS3	Comunicação	2.39
LREN3	Consumo Cíclico	2.37
SUZB3	Materiais Básicos	2.32
ITSA4	Financeiro	2.28
TRPL4	Utilidade Pública	2.25
CMIG4	Utilidade Pública	2.25

Participação por Tipo Investidor*

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



Participação na posição em custódia (R$) – February/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	5.29	-33.41	15.32	66.17	133.87	3.19
MGLU3	Consumo Cíclico	-18.96	-40.27	3.59	82.38	127.23	3.06
BBAS3	Financeiro	0.99	30.83	40.30	33.45	123.07	2.70
VIVT3	Comunicação	-6.89	-16.99	38.94	22.76	111.73	2.68
EGIE3	Utilidade Pública	-0.18	3.96	39.28	20.46	127.00	2.50
CCRO3	Bens Industriais	-6.55	-3.79	10.99	34.01	101.28	2.44
KLBN11	Materiais Básicos	2.25	-9.88	19.46	28.05	103.51	2.43
SANB11	Financeiro	-2.14	-2.92	28.33	30.25	96.40	2.43
ITUB4	Financeiro	0.46	3.83	25.43	27.32	99.64	2.40
TIMS3	Comunicação	3.99	-5.61	12.26	24.64	93.80	2.39
LREN3	Consumo Cíclico	-13.78	-24.24	18.65	45.08	111.61	2.37
SUZB3	Materiais Básicos	2.98	-9.14	47.74	31.93	100.16	2.32
ITSA4	Financeiro	-3.52	-4.77	8.23	25.81	107.63	2.28
TRPL4	Utilidade Pública	-4.85	-6.74	21.76	18.92	103.78	2.25
CMIG4	Utilidade Pública	-8.55	20.38	10.48	34.39	123.53	2.25
WEGE3	Bens Industriais	2.99	35.41	39.16	34.19	100.00	2.22

*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
CPLE6	Utilidade Pública	-9.27	14.15	7.05	35.68	137.50	2.21
RAIL3	Bens Industriais	-2.29	16.00	17.96	34.92	105.09	2.18
BBDC4	Financeiro	-6.58	-24.73	13.08	34.34	111.89	2.17
ENEV3	Utilidade Pública	-4.75	-15.14	11.43	36.05	101.24	2.16
RADL3	Saúde	-8.66	-1.82	22.68	29.41	96.52	2.13
VBBR3	Petróleo e Gás	-10.15	-34.13	14.79	37.56	113.00	2.02
BRFS3	Consumo Não Cíclico	-22.61	-63.14	6.16	58.55	134.66	1.99
BPAC11	Financeiro	-6.57	-19.05	20.20	0.00	-	1.99
CSAN3	Petróleo e Gás	-10.30	-27.42	14.98	37.26	121.92	1.96
STBP3	Bens Industriais	-9.08	34.07	8.01	46.16	94.28	1.95
ASAI3	Consumo Não Cíclico	-7.68	36.12	18.14	34.27	106.76	1.94
ELET3	Utilidade Pública	-15.57	0.56	34.32	33.56	88.06	1.90
ABEV3	Consumo Não Cíclico	-1.98	-7.27	13.39	24.97	86.07	1.89
HYPE3	Saúde	-10.24	28.11	41.65	30.61	109.52	1.85
RDOR3	Saúde	-19.91	-49.29	25.55	45.26	128.11	1.82
B3SA3	Financeiro	-18.32	-24.66	10.55	44.05	114.80	1.78

*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
CPFE3	Utilidade Pública	-8.98	9.96	30.29	29.86	120.40	1.66
BRKM5	Materiais Básicos	-13.76	-56.15	20.12	46.38	94.44	1.54
CIEL3	Financeiro	-4.19	96.74	4.80	45.75	92.02	1.53
FLRY3	Saúde	-8.33	-15.13	14.19	38.96	118.49	1.49
ENBR3	Utilidade Pública	-3.63	6.59	19.63	22.80	118.44	1.41
SLCE3	Consumo Não Cíclico	-3.96	18.33	49.27	37.13	91.77	1.38
ARZZ3	Consumo Cíclico	-14.84	-5.89	74.60	37.06	100.79	1.33
VAMO3	Consumo Cíclico	-9.17	22.76	13.28	47.28	99.52	1.22
COGN3	Consumo Cíclico	-15.13	-10.62	2.02	54.94	100.00	1.11
RAIZ4	Consumo Não Cíclico	-6.38	-44.05	3.08	47.31	111.00	1.06
USIM5	Materiais Básicos	-19.93	-51.06	6.83	45.69	96.39	1.03
SAPR11	Utilidade Pública	-0.99	-7.99	17.06	28.98	116.43	1.00
VIIA3	Consumo Cíclico	-19.58	-49.08	1.93	74.34	113.20	0.92
AESB3	Utilidade Pública	-1.78	-12.51	9.92	24.43	78.55	0.91
BEEF3	Consumo Não Cíclico	-19.01	9.21	11.33	41.75	102.45	0.86
NEOE3	Utilidade Pública	-6.57	-7.36	14.07	26.99	115.15	0.81

*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
PCAR3	Consumo Não Cíclico	-25.00	-32.19	15.54	47.71	106.52	0.77
AZUL4	Bens Industriais	-39.83	-71.81	7.13	70.42	120.21	0.71
MDIA3	Consumo Não Cíclico	-1.90	47.80	33.57	43.52	130.30	0.68
ALSO3	Financeiro	-5.16	-21.69	17.08	35.54	95.49	0.63
MRFG3	Consumo Não Cíclico	-17.27	-64.83	6.37	46.27	118.82	0.60
CBAV3	Materiais Básicos	-17.95	-46.49	10.42	59.46	100.08	0.58
MRVE3	Consumo Cíclico	-15.95	-48.60	5.90	56.57	129.13	0.55
BPAN4	Financeiro	-11.38	-46.33	5.14	49.26	71.16	0.52
DXCO3	Materiais Básicos	-13.53	-45.49	6.52	45.03	114.49	0.51
GRND3	Consumo Cíclico	0.76	-18.75	6.59	37.68	98.46	0.50
SIMH3	Financeiro	-7.59	-27.10	7.18	49.52	106.89	0.47
MYPK3	Consumo Cíclico	-1.66	-8.04	11.27	41.06	97.14	0.42
ECOR3	Bens Industriais	-9.69	-36.71	4.10	49.85	128.84	0.37
LIGT3	Utilidade Pública	-34.38	-73.91	2.50	64.93	150.34	0.28
AMBP3	Utilidade Pública	-15.11	-40.03	20.33	53.02	95.81	0.26
MOVI3	Consumo Cíclico	-12.85	-55.35	6.58	51.94	126.07	0.25

*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	8.06	54.23	8.58	38.53	86.99	0.24
DASA3	Saúde	-15.77	-62.90	9.24	50.67	75.01	0.20
GFSA3	Consumo Cíclico	-35.88	-46.30	8.31	119.78	243.70	0.15
GUAR3	Consumo Cíclico	-13.33	-63.26	4.42	63.26	125.02	0.11
AERI3	Bens Industriais	-16.35	-76.50	1.33	81.93	160.46	0.09

*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