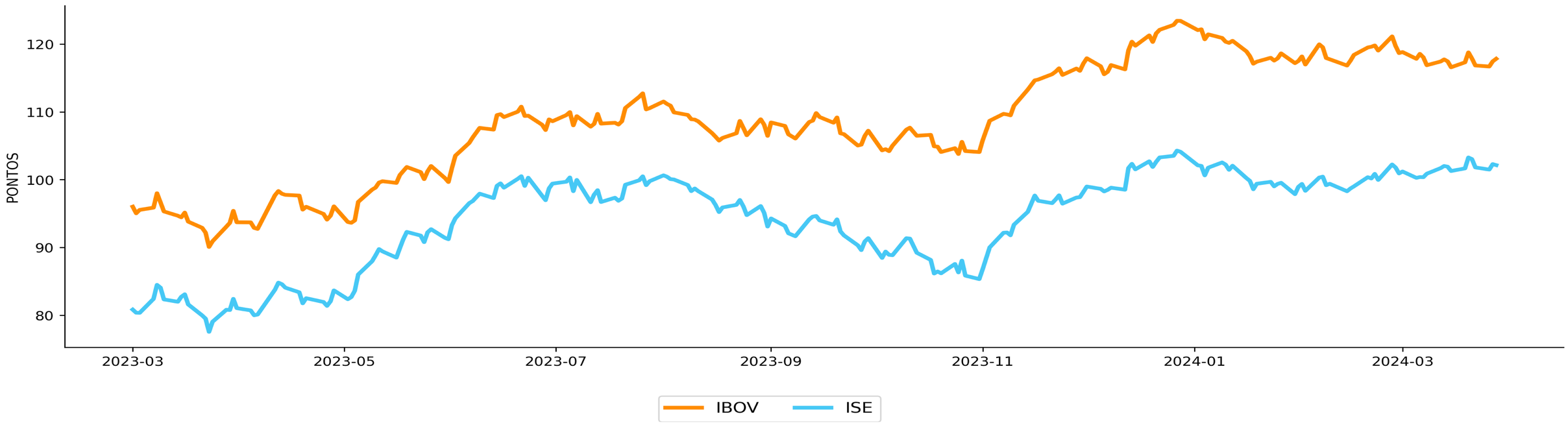
Boletim Mensal de ISE

March/2024

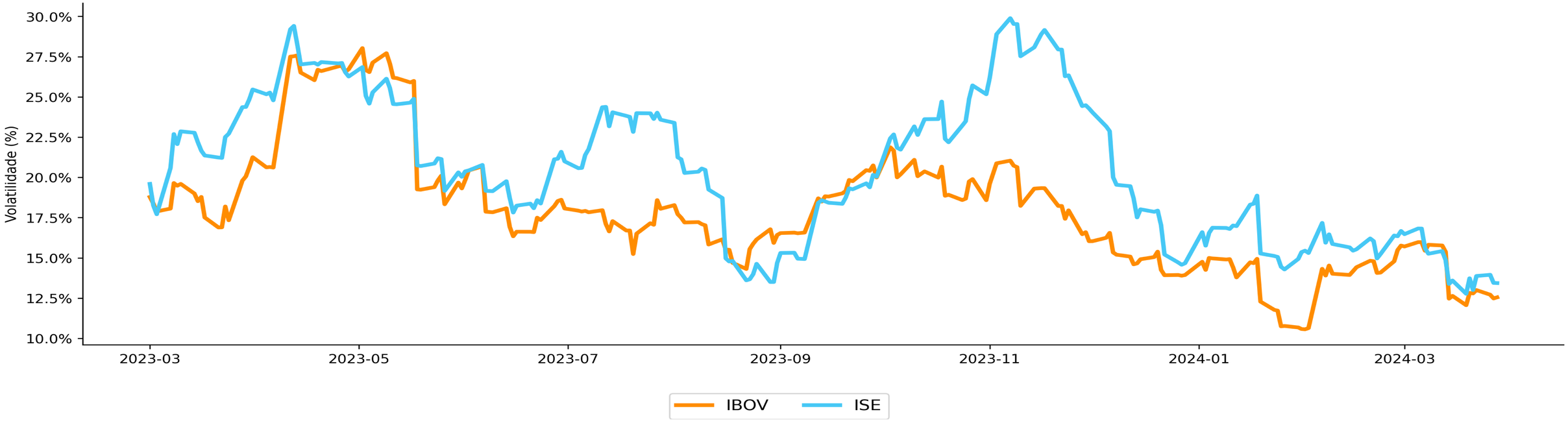
Comparativo ISE e Outros Indicadores



Indice	Variação MoM (%)	Variação YTD (%)	Variação 12M (%)	Variação Total (%)*
IGPTW B3	1.85	-0.18	20.62	-2.45
IBOV	-0.71	-3.46	25.74	17.83
IBRX 50	-0.81	-3.16	24.88	19.63
IBRX 100	-0.73	-3.25	25.18	18.78
ICO2	0.37	-0.88	30.34	-3.15
IGC TRADE	-0.44	-2.74	26.82	20.54
IGC - NM	0.68	-3.28	18.17	7.70
ISE	1.21	0.03	26.03	2.14

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

Volatilidade ISE e Outros Indicadores

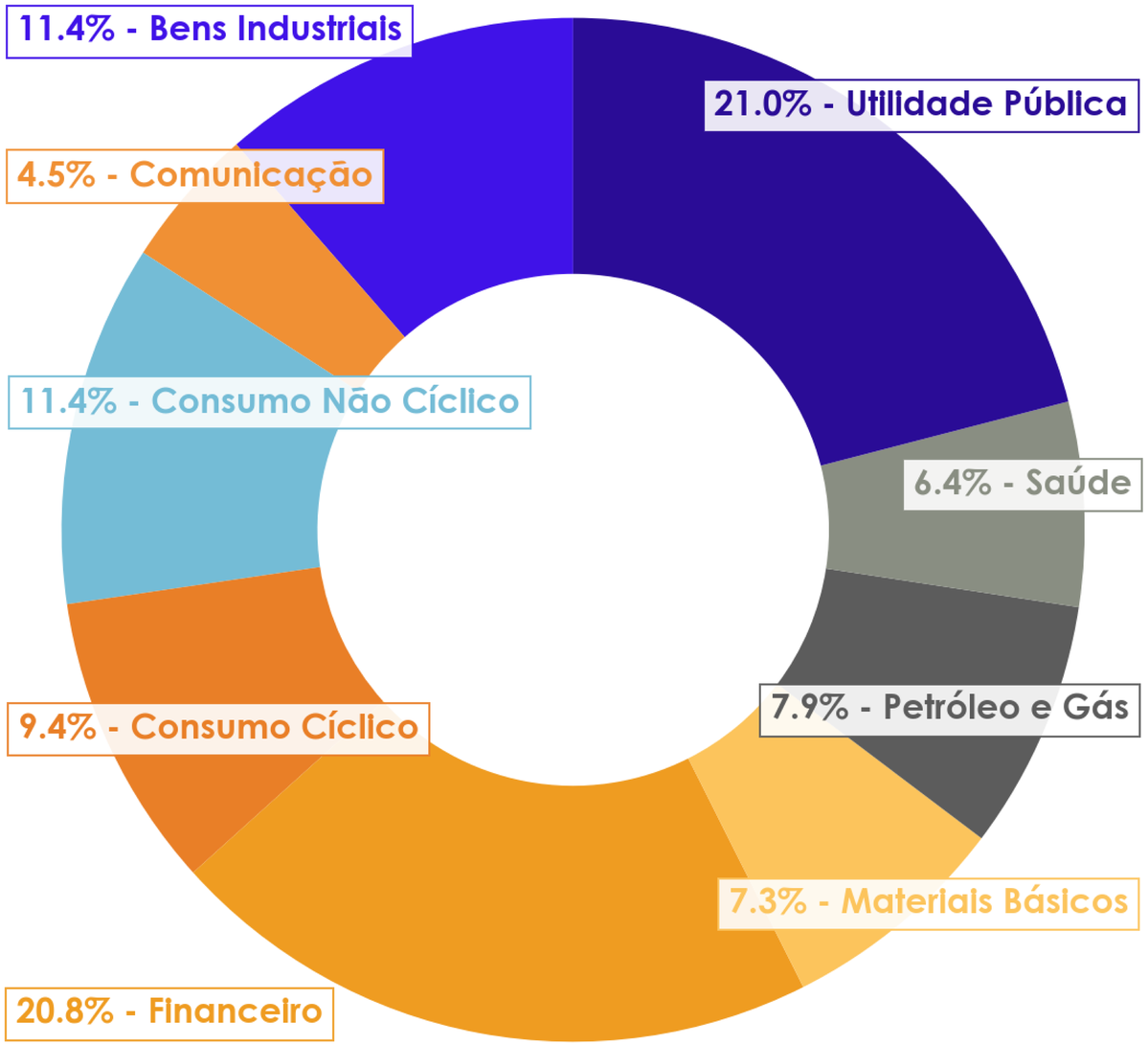


Variação Índice	Varição - Mês (%)*	Variação - Ano (%)**
IGPTW B3	-5.27	-45.42
IBOV	-20.40	-40.97
IBRX 50	-16.70	-38.50
IBRX 100	-17.94	-38.14
ICO2	-21.06	-44.65
IGC TRADE	-17.11	-37.84
IGC - NM	-14.82	-43.88
ISE	-19.42	-47.24

*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

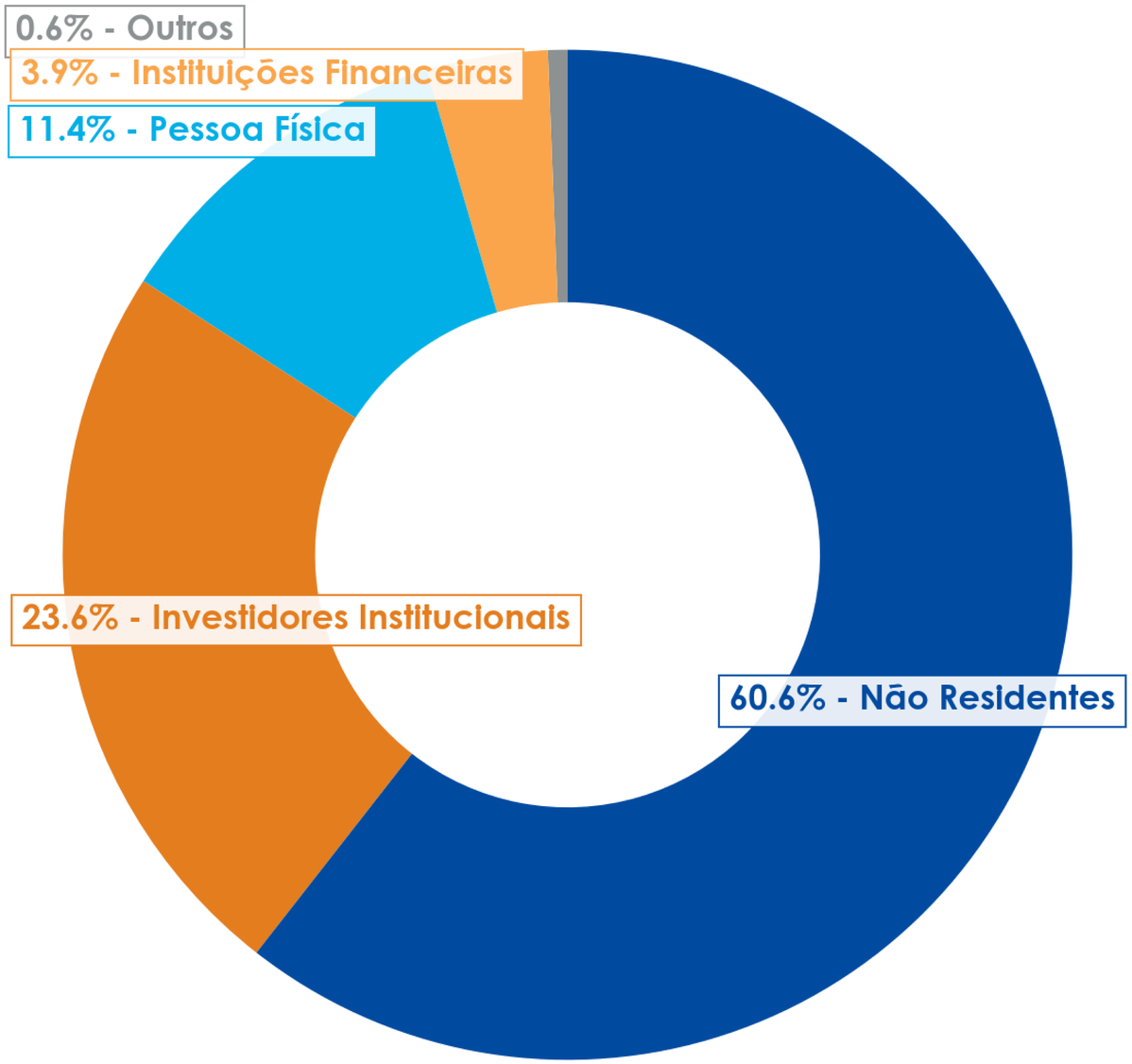


Composição ISE - TOP 15 Ativos

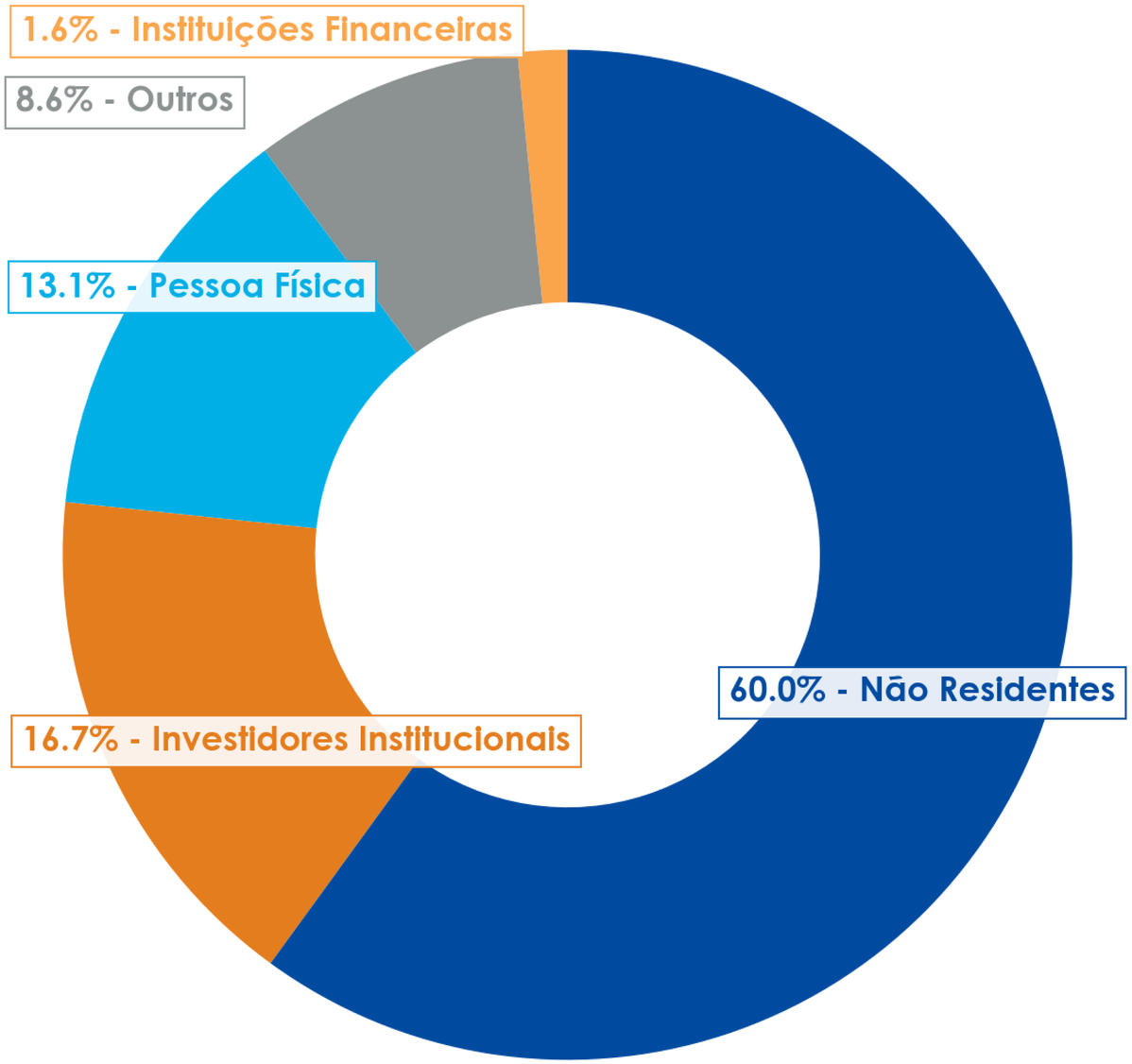
Ticker	Setor Econômico	% Mercado
STBP3	Bens Industriais	2.62
SUZB3	Materiais Básicos	2.61
KLBN11	Materiais Básicos	2.60
NTCO3	Consumo Não Cíclico	2.47
CMIG4	Utilidade Pública	2.36
BRFS3	Consumo Não Cíclico	2.34
VBBR3	Petróleo e Gás	2.24
TIMS3	Comunicação	2.23
VIVT3	Comunicação	2.22
BBAS3	Financeiro	2.22
ITUB4	Financeiro	2.20
ITSA4	Financeiro	2.17
LREN3	Consumo Cíclico	2.16
ASAI3	Consumo Não Cíclico	2.13
TRPL4	Utilidade Pública	2.09

Participação por Tipo Investidor*

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



Participação na posição em custódia (R$) – March/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
STBP3	Bens Industriais	27.83	74.79	13.32	31.58	71.38	2.62
SUZB3	Materiais Básicos	13.54	57.39	63.98	24.38	81.78	2.61
KLBN11	Materiais Básicos	11.92	47.79	25.26	22.06	82.93	2.60
NTCO3	Consumo Não Cíclico	13.99	40.84	17.88	42.42	65.58	2.47
CMIG4	Utilidade Pública	6.43	22.18	12.56	24.65	74.65	2.36
BRFS3	Consumo Não Cíclico	8.08	162.80	16.32	52.57	87.25	2.34
VBBR3	Petróleo e Gás	-3.29	80.70	25.01	32.84	87.09	2.24
TIMS3	Comunicação	-1.59	51.09	17.80	21.33	88.21	2.23
VIVT3	Comunicação	-7.12	37.81	50.60	19.89	85.81	2.22
BBAS3	Financeiro	-1.44	58.73	56.62	21.45	64.74	2.22
ITUB4	Financeiro	2.84	50.71	34.64	19.53	71.28	2.20
ITSA4	Financeiro	2.86	47.13	10.50	18.47	73.24	2.17
LREN3	Consumo Cíclico	8.51	6.88	16.98	47.05	106.67	2.16
ASAI3	Consumo Não Cíclico	3.59	-4.95	14.71	45.52	136.04	2.13
TRPL4	Utilidade Pública	-3.80	25.03	24.82	21.95	117.19	2.09
CCRO3	Bens Industriais	0.29	9.69	13.82	22.13	67.51	2.09

*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;

Composição de Carteira

Código Ativo	Setor Econômico	Lucratividade (Mês) (%)*	Lucratividade (Ano) (%)**	Preço de Fechamento (R$)	Volatilidade Ativo (Mês) (%)***	Volatilidade Ativo (Ano) (%)****	Participação Ativo
ELET3	Utilidade Pública	-4.14	26.12	41.70	28.00	82.45	2.08
CPLE6	Utilidade Pública	-5.87	43.99	9.62	20.27	57.05	2.07
RAIL3	Bens Industriais	-2.02	18.50	22.26	25.08	75.09	2.07
BPAC11	Financeiro	0.11	89.70	36.43	0.00	-	2.07
WEGE3	Bens Industriais	4.27	-4.00	38.20	25.65	78.30	2.06
EGIE3	Utilidade Pública	-4.19	7.34	40.26	16.28	79.07	2.05
RADL3	Saúde	2.74	17.74	27.37	22.74	77.69	1.97
SANB11	Financeiro	-0.28	12.72	28.52	21.45	74.97	1.96
RDOR3	Saúde	0.48	21.52	25.31	37.25	77.06	1.93
ENEV3	Utilidade Pública	-0.62	21.78	12.75	28.59	84.89	1.90
BBDC4	Financeiro	3.85	15.89	14.26	29.58	85.74	1.88
CSAN3	Petróleo e Gás	-4.71	10.27	16.20	29.10	79.16	1.82
UGPA3	Petróleo e Gás	-1.68	109.61	28.47	26.93	67.48	1.79
B3SA3	Financeiro	-6.13	19.77	11.99	31.87	71.86	1.77
HYPE3	Saúde	0.43	-9.77	32.93	30.68	101.22	1.73
ALOS3	Financeiro	-3.12	39.80	23.92	24.85	-	1.63

*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	-0.72	-8.28	12.49	19.01	79.31	1.53
EQTL3	Utilidade Pública	-4.77	22.42	32.55	20.16	72.67	1.52
CPFE3	Utilidade Pública	-1.64	20.10	34.81	19.23	62.35	1.48
CIEL3	Financeiro	3.93	22.26	5.40	33.84	78.19	1.32
PSSA3	Financeiro	9.52	39.80	31.28	22.45	76.94	1.28
MGLU3	Consumo Cíclico	-15.49	-45.28	1.80	73.31	89.25	1.28
SAPR11	Utilidade Pública	0.77	53.13	26.03	24.94	86.57	1.18
USIM5	Materiais Básicos	-9.58	43.96	10.01	29.73	65.69	1.16
IGTI11	Financeiro	-0.89	23.46	23.31	24.58	66.22	1.15
ENAT3	Petróleo e Gás	15.86	163.98	29.52	45.19	97.71	1.12
AZUL4	Bens Industriais	7.86	8.40	13.04	59.33	72.05	1.04
COGN3	Consumo Cíclico	-6.35	26.20	2.36	47.06	89.86	0.97
CSMG3	Utilidade Pública	9.79	58.74	21.78	27.98	70.51	0.91
RAIZ4	Petróleo e Gás	0.46	30.57	3.54	37.24	76.30	0.91
NEOE3	Utilidade Pública	-5.79	45.85	20.35	25.52	93.58	0.90
ARZZ3	Consumo Cíclico	8.51	4.21	64.27	42.33	109.52	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
SLCE3	Consumo Não Cíclico	0.61	1.84	19.78	25.58	74.36	0.86
SOMA3	Consumo Cíclico	8.71	-5.02	7.61	52.48	102.38	0.83
FLRY3	Saúde	-4.79	12.42	15.00	24.22	63.44	0.82
AURE3	Utilidade Pública	-4.27	2.87	11.90	15.66	55.43	0.80
VAMO3	Consumo Cíclico	-4.35	-35.30	8.35	47.76	101.90	0.78
PORT3	Bens Industriais	3.71	97.93	17.89	24.73	90.03	0.77
AESB3	Utilidade Pública	-2.30	2.62	10.20	23.05	99.44	0.72
BPAN4	Financeiro	8.68	91.31	9.52	37.87	78.55	0.72
SRNA3	Utilidade Pública	0.53	-1.47	9.41	40.48	-	0.70
MRFG3	Consumo Não Cíclico	4.14	56.16	10.31	43.30	94.40	0.68
MRVE3	Consumo Cíclico	2.23	22.10	7.79	54.39	98.82	0.66
ECOR3	Bens Industriais	-11.22	58.96	8.15	37.91	74.95	0.62
MDIA3	Consumo Não Cíclico	-7.24	53.92	38.18	32.89	69.55	0.58
DXCO3	Materiais Básicos	-4.84	35.21	7.68	44.25	94.13	0.53
MYPK3	Consumo Cíclico	15.96	21.37	14.47	33.29	81.14	0.42
BEEF3	Consumo Não Cíclico	-0.88	-32.09	6.75	40.77	96.54	0.39

*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
GRND3	Consumo Cíclico	2.48	10.56	6.61	27.08	74.77	0.38
SIMH3	Financeiro	-3.38	-0.40	7.43	43.16	84.49	0.37
PCAR3	Consumo Não Cíclico	-26.55	-51.48	2.96	67.53	140.02	0.26
CEAB3	Consumo Cíclico	13.55	281.36	10.64	64.30	82.07	0.24
MOVI3	Consumo Cíclico	-0.35	6.54	8.50	51.20	89.53	0.23
RANI3	Materiais Básicos	1.32	16.16	9.21	33.34	91.02	0.21
CAML3	Consumo Não Cíclico	5.03	36.94	8.98	36.40	75.36	0.19
AMBP3	Utilidade Pública	5.55	-26.02	15.60	46.97	88.02	0.19
GFSA3	Consumo Cíclico	-10.49	30.16	6.64	107.26	89.09	0.18
CBAV3	Materiais Básicos	2.00	-42.33	4.08	52.03	90.06	0.18
JSLG3	Bens Industriais	4.89	93.92	12.44	39.55	81.09	0.17
GUAR3	Consumo Cíclico	38.33	93.02	8.30	66.09	102.74	0.14
BHIA3	Consumo Cíclico	-25.00	-85.57	6.78	74.98	-	0.13
MTRE3	Consumo Cíclico	-14.29	66.12	5.10	57.17	106.22	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