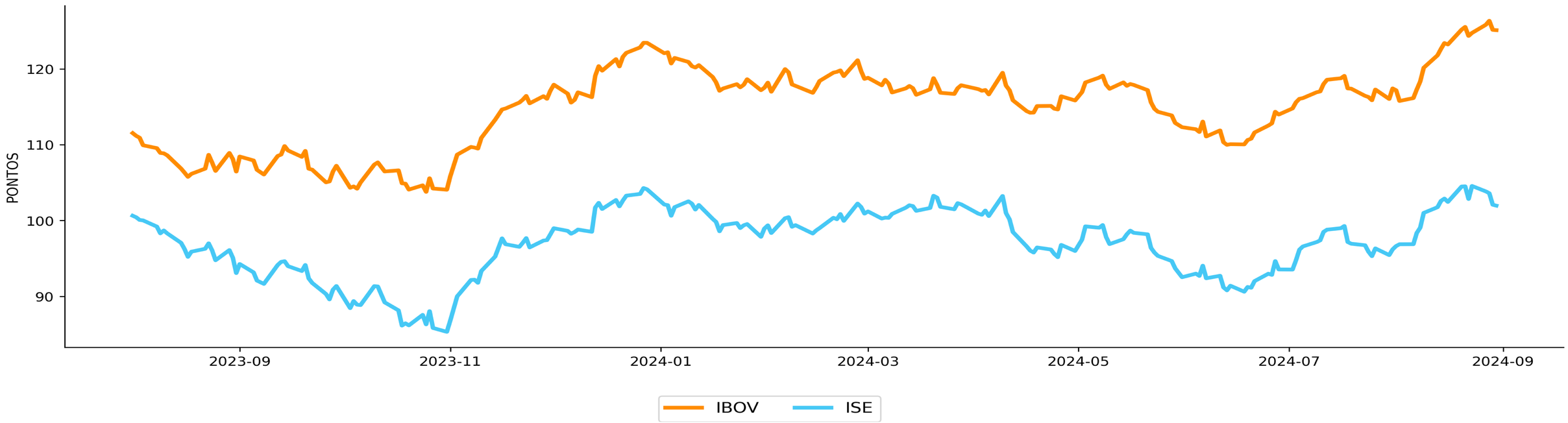
Boletim Mensal de ISE

August/2024

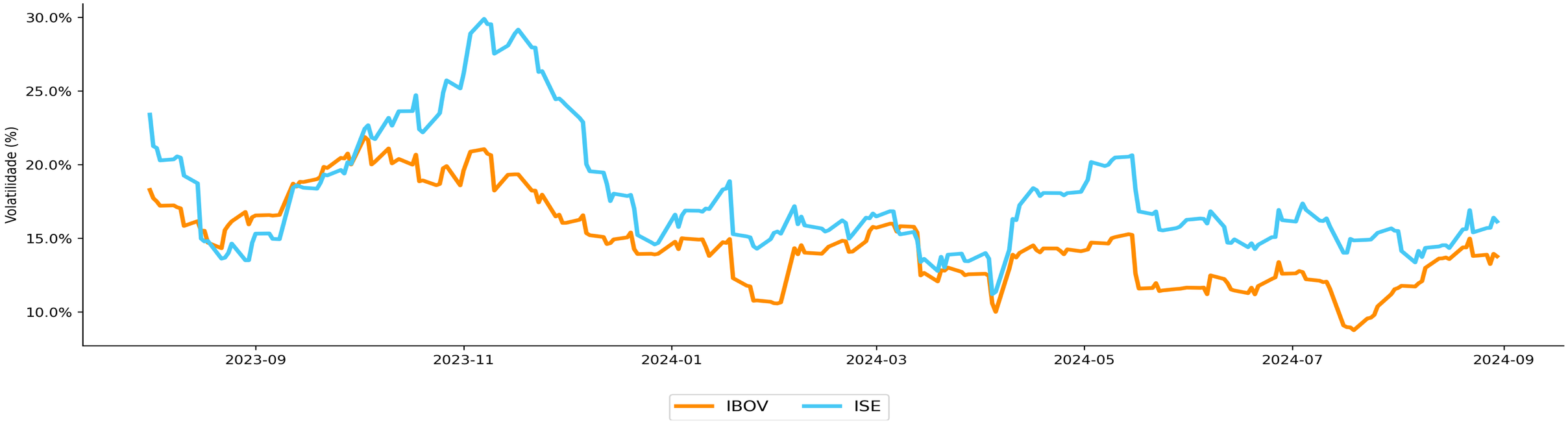
Comparativo ISE e Outros Indicadores



Indice	Variação MoM (%)	Variação YTD (%)	Variação 12M (%)	Variação Total (%)*
IGPTW B3	5.92	-4.04	1.50	-6.22
IBOV	6.54	2.49	17.51	25.10
IBRX 50	6.51	4.11	19.46	28.62
IBRX 100	6.60	2.90	18.00	26.33
ICO2	7.74	3.69	17.57	1.32
IGC TRADE	6.50	3.30	17.94	28.03
IGC - NM	4.87	-0.43	11.00	10.88
ISE	5.99	-0.14	9.55	1.97

*Mês base para cálculo da Variação Total fixado em Novembro de 2019.

Volatilidade ISE e Outros Indicadores

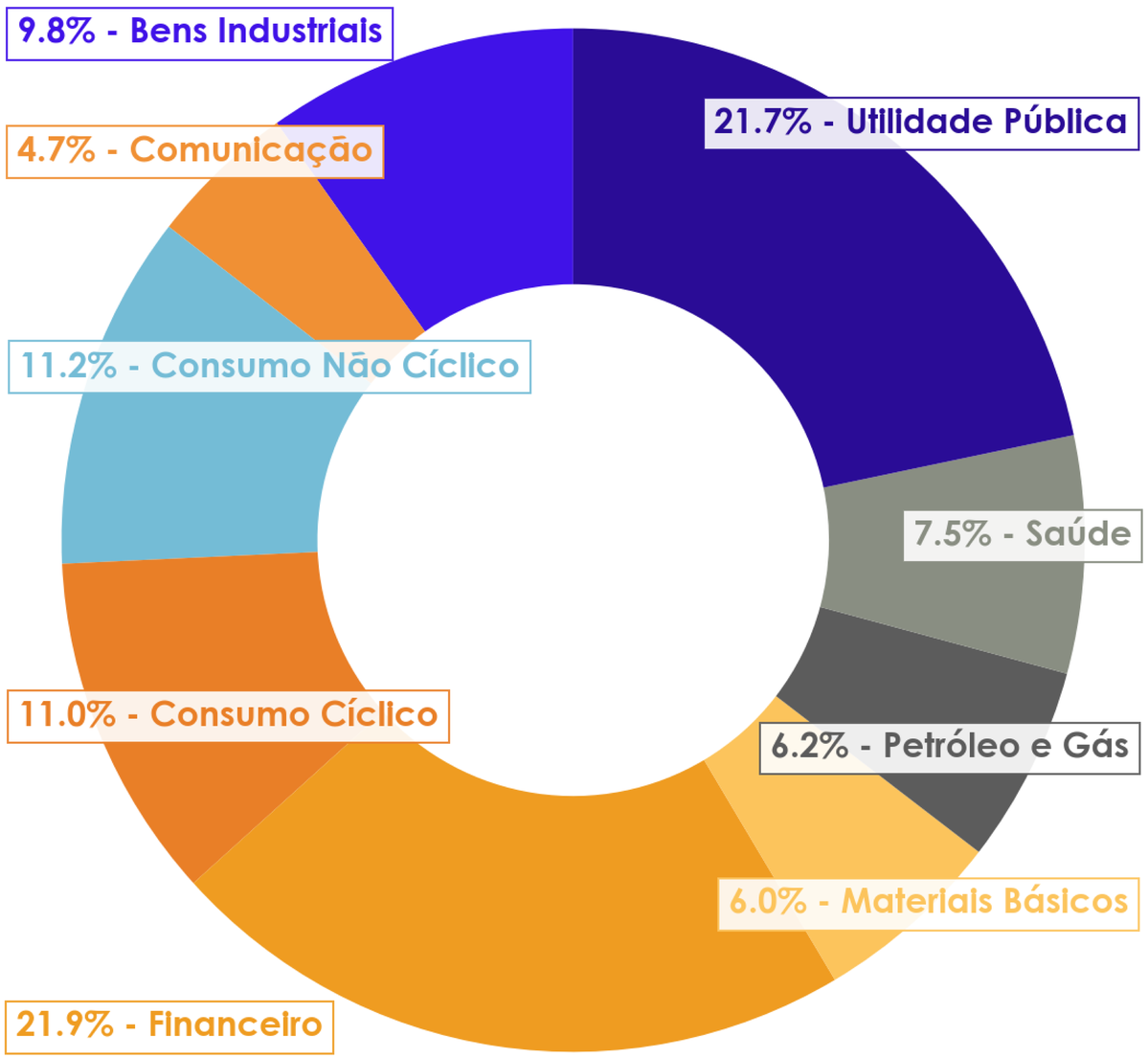


Variação Índice	Variação - Mês (%)*	Variação - Ano (%)**
IGPTW B3	7.64	-0.14
IBOV	19.30	-16.21
IBRX 50	25.92	-15.13
IBRX 100	19.40	-15.59
ICO2	9.10	-9.66
IGC TRADE	18.14	-13.96
IGC - NM	9.67	9.41
ISE	4.03	9.82

*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

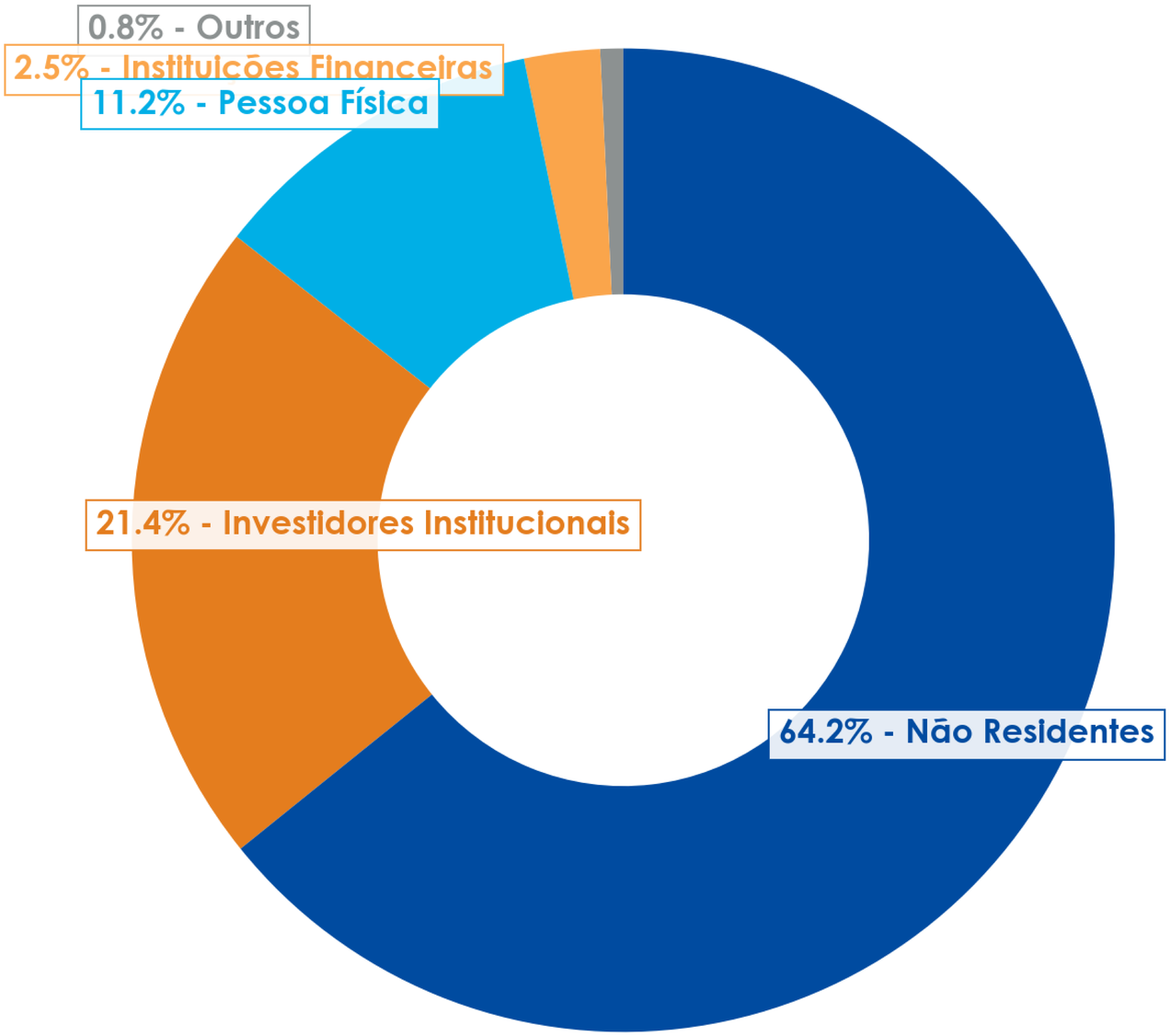


Composição ISE - TOP 15 Ativos

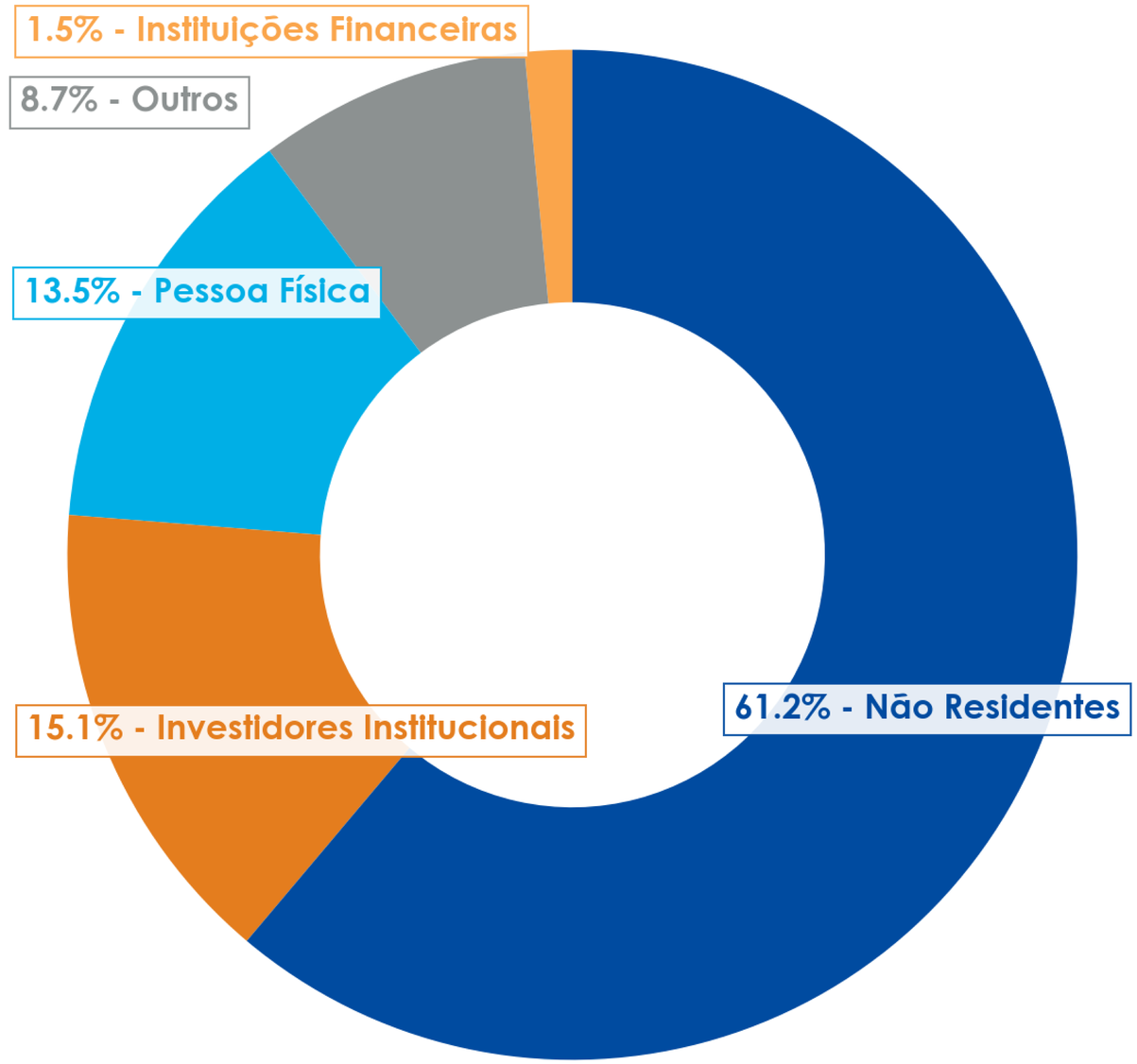
Ticker	Setor Econômico	% Mercado
BRFS3	Consumo Não Cíclico	2.93
WEGE3	Bens Industriais	2.57
RDOR3	Saúde	2.50
LREN3	Consumo Cíclico	2.49
VIVT3	Comunicação	2.43
CPLE6	Utilidade Pública	2.42
BBDC4	Financeiro	2.39
EGIE3	Utilidade Pública	2.38
ITUB4	Financeiro	2.37
B3SA3	Financeiro	2.35
CMIG4	Utilidade Pública	2.35
SANB11	Financeiro	2.30
ITSA4	Financeiro	2.29
TIMS3	Comunicação	2.25
CCRO3	Bens Industriais	2.23

Participação por Tipo Investidor*

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



Participação na posição em custódia (R$) – August/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
BRFS3	Consumo Não Cíclico	24.55	190.15	26.23	42.75	67.52	2.93
WEGE3	Bens Industriais	7.29	53.78	54.15	26.63	93.77	2.57
RDOR3	Saúde	15.73	14.27	31.93	34.65	75.77	2.50
LREN3	Consumo Cíclico	28.28	11.10	17.01	42.21	85.20	2.49
VIVT3	Comunicação	7.34	33.04	51.83	21.46	93.55	2.43
CPLE6	Utilidade Pública	3.37	28.32	10.43	20.51	57.21	2.42
BBDC4	Financeiro	26.01	14.21	15.64	27.17	75.45	2.39
EGIE3	Utilidade Pública	4.64	13.52	45.16	17.66	90.61	2.38
ITUB4	Financeiro	8.38	43.74	36.70	18.05	66.53	2.37
B3SA3	Financeiro	16.87	1.38	12.68	29.20	67.56	2.35
CMIG4	Utilidade Pública	11.71	43.69	11.63	27.40	89.81	2.35
SANB11	Financeiro	9.60	22.66	31.40	21.46	76.64	2.30
ITSA4	Financeiro	7.77	34.69	10.96	17.98	72.91	2.29
TIMS3	Comunicação	2.12	32.73	17.86	23.08	96.49	2.25
CCRO3	Bens Industriais	7.03	10.03	13.25	22.68	75.20	2.23
RADL3	Saúde	-0.14	1.38	27.56	24.95	98.46	2.23

*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
ELET3	Utilidade Pública	5.51	19.69	41.75	25.24	75.14	2.21
BPAC11	Financeiro	9.05	12.11	35.56	0.00	-	2.21
KLBN11	Materiais Básicos	-0.70	10.49	21.59	20.11	81.45	2.19
RAIL3	Bens Industriais	-1.35	-1.79	21.85	25.37	79.88	2.18
BBAS3	Financeiro	7.66	30.82	28.12	18.29	57.12	2.11
ALOS3	Financeiro	4.44	5.85	22.81	22.99	-	2.04
ENEV3	Utilidade Pública	3.96	10.15	13.13	26.20	81.16	2.03
VBBR3	Petróleo e Gás	11.05	52.19	25.72	27.51	69.45	2.02
SUZB3	Materiais Básicos	2.12	12.24	55.00	28.32	102.02	2.01
TRPL4	Utilidade Pública	0.61	8.25	24.71	25.35	146.53	1.91
ABEV3	Consumo Não Cíclico	11.05	-2.22	12.86	19.21	89.72	1.87
CSAN3	Petróleo e Gás	-0.07	-21.06	13.36	27.55	76.53	1.85
NTCO3	Consumo Não Cíclico	-9.24	-7.02	13.55	37.67	66.77	1.73
HYPE3	Saúde	-0.90	-23.87	28.54	32.83	120.79	1.71
STBP3	Bens Industriais	0.93	61.35	13.00	35.41	88.75	1.63
AZZA3	Consumo Cíclico	0.72	-28.65	49.00	39.08	-	1.51

*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	4.96	8.37	34.09	18.31	66.80	1.50
PSSA3	Financeiro	11.31	37.48	34.06	21.30	78.17	1.49
CYRE3	Consumo Cíclico	11.95	1.59	21.82	34.70	74.99	1.43
UGPA3	Petróleo e Gás	6.30	31.82	23.36	27.70	75.95	1.41
SAPR11	Utilidade Pública	4.90	32.87	28.66	23.03	76.46	1.39
ASAI3	Consumo Não Cíclico	-2.55	-17.57	9.57	38.94	91.47	1.28
IGTI11	Financeiro	4.79	10.65	22.09	25.50	75.38	1.18
CRFB3	Consumo Não Cíclico	-3.13	-12.57	8.97	42.14	91.63	1.16
MGLU3	Consumo Cíclico	9.85	-55.67	12.16	73.54	99.92	1.10
CSMG3	Utilidade Pública	7.97	57.79	23.72	28.40	75.29	1.08
AMBP3	Utilidade Pública	40.97	240.79	71.26	89.51	171.18	0.95
RAIZ4	Petróleo e Gás	7.72	-7.26	3.21	33.05	72.54	0.94
NEOE3	Utilidade Pública	9.82	13.76	19.90	22.23	80.46	0.93
FLRY3	Saúde	7.49	14.43	15.95	20.98	64.89	0.93
VAMO3	Consumo Cíclico	-11.94	-32.97	7.60	50.45	106.95	0.93
AESB3	Utilidade Pública	1.42	4.55	11.45	24.11	104.42	0.88

*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
SRNA3	Utilidade Pública	-6.25	-19.08	8.10	37.02	-	0.84
SLCE3	Consumo Não Cíclico	-1.67	-7.93	17.66	23.20	82.53	0.83
AURE3	Utilidade Pública	-4.12	-3.98	11.39	16.76	77.16	0.83
BPAN4	Financeiro	14.06	15.96	9.90	31.43	71.21	0.78
USIM5	Materiais Básicos	0.16	-6.32	6.23	41.36	106.63	0.78
YDUQ3	Consumo Cíclico	-9.96	-50.78	9.85	48.60	70.73	0.70
MRVE3	Consumo Cíclico	11.00	-34.24	7.47	49.19	87.59	0.67
ECOR3	Bens Industriais	10.44	7.63	7.83	37.72	74.47	0.62
COGN3	Consumo Cíclico	-9.87	-53.08	1.37	48.86	96.73	0.62
DXCO3	Materiais Básicos	12.31	6.77	8.21	41.42	86.73	0.58
BEEF3	Consumo Não Cíclico	19.08	-10.83	7.49	34.50	74.87	0.48
AZUL4	Bens Industriais	-32.63	-62.80	5.39	61.51	74.89	0.44
MDIA3	Consumo Não Cíclico	0.82	-25.71	27.16	27.10	66.15	0.44
GRND3	Consumo Cíclico	2.28	-7.33	6.00	24.80	75.84	0.39
MYPK3	Consumo Cíclico	-7.37	-15.23	11.57	35.09	92.59	0.36
SIMH3	Financeiro	-2.53	-36.72	6.17	50.80	99.59	0.34

*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	18.11	-36.64	3.13	69.01	127.02	0.29
CEAB3	Consumo Cíclico	20.50	90.09	10.17	62.47	81.59	0.25
CBAV3	Materiais Básicos	-6.21	16.49	4.98	51.04	89.69	0.25
CAML3	Consumo Não Cíclico	8.05	15.96	9.53	34.27	72.04	0.22
MOVI3	Consumo Cíclico	9.34	-42.47	7.14	50.77	82.10	0.21
RANI3	Materiais Básicos	-4.83	-22.74	7.99	29.94	92.46	0.21
GUAR3	Consumo Cíclico	26.42	40.89	8.66	62.96	94.65	0.17
JSLG3	Bens Industriais	4.87	17.87	9.91	40.03	86.42	0.15
DASA3	Saúde	8.73	-72.87	2.99	71.74	106.41	0.12
GFSA3	Consumo Cíclico	-17.55	-38.36	2.63	105.25	84.27	0.06
MTRE3	Consumo Cíclico	-5.14	-26.43	3.72	52.81	97.11	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