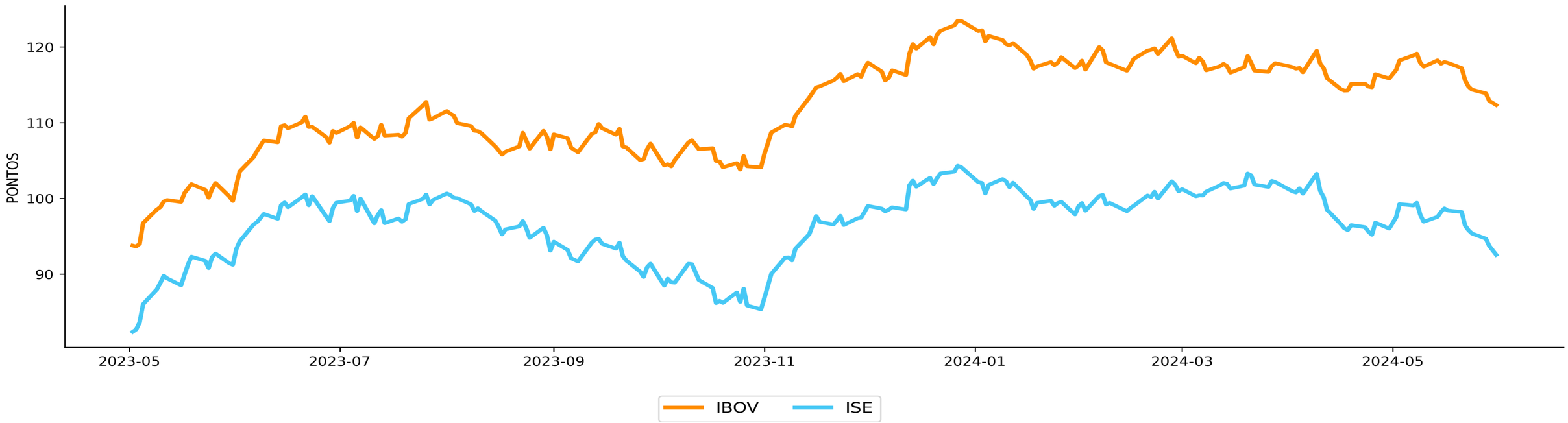
Boletim Mensal de ISE

May/2024

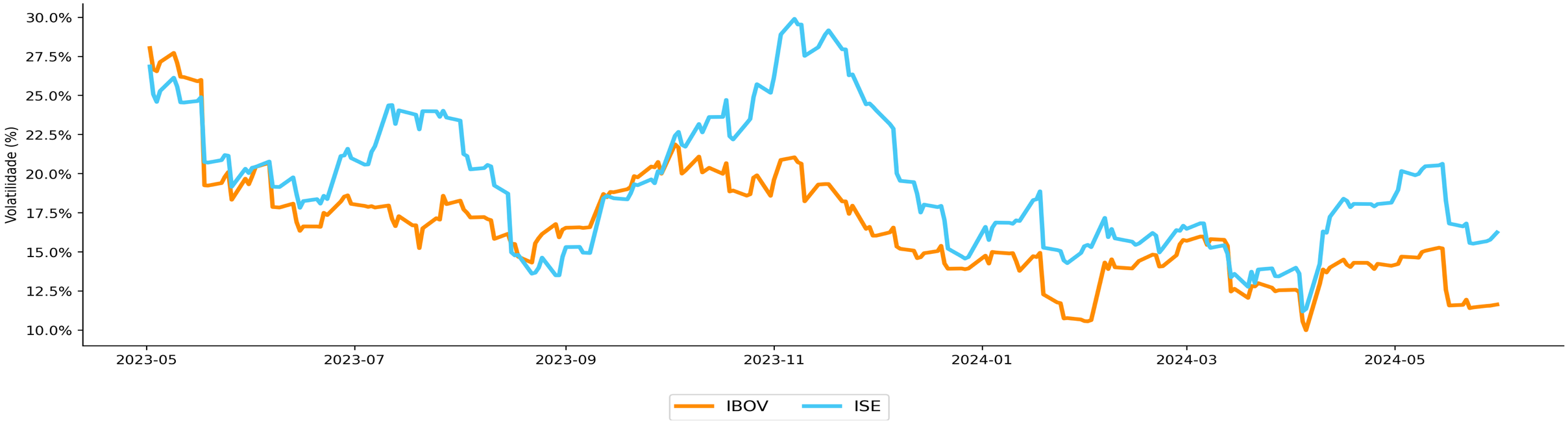
Comparativo ISE e Outros Indicadores



Indice	Variação MoM (%)	Variação YTD (%)	Variação 12M (%)	Variação Total (%)*
IGPTW B3	-4.80	-10.02	-3.16	-12.07
IBOV	-3.04	-7.99	12.70	12.31
IBRX 50	-3.11	-6.75	14.94	15.19
IBRX 100	-3.18	-7.58	13.24	13.47
ICO2	-3.40	-8.70	7.72	-10.79
IGC TRADE	-2.98	-7.12	13.74	15.12
IGC - NM	-2.70	-9.27	5.56	1.04
ISE	-3.61	-9.38	1.45	-7.47

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

Volatilidade ISE e Outros Indicadores

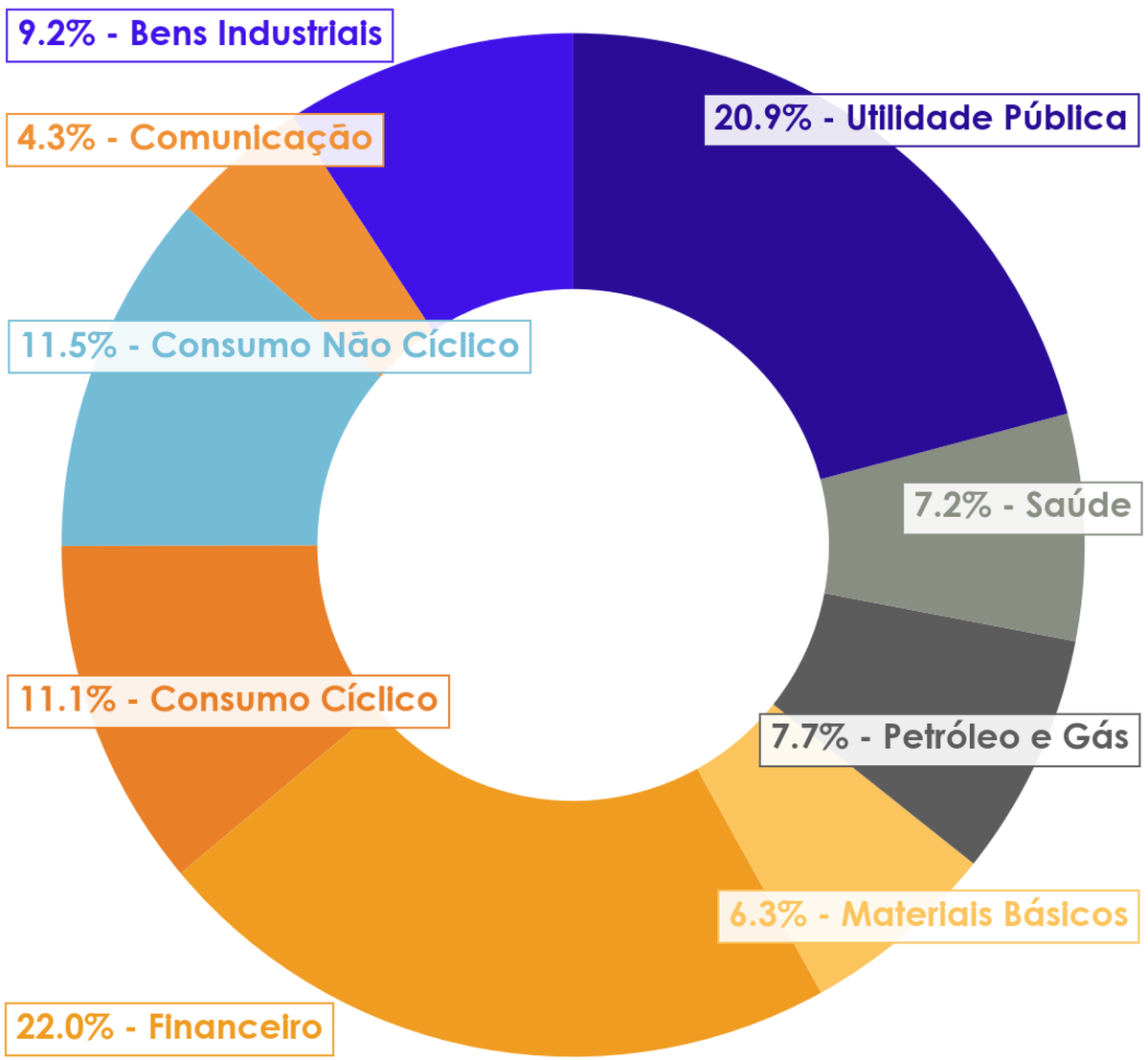


Variação Índice	Variação - Mês (%)*	Variação - Ano (%)**
IGPTW B3	-7.60	-23.07
IBOV	-17.53	-39.76
IBRX 50	-17.78	-43.80
IBRX 100	-19.11	-40.90
ICO2	-5.65	-18.30
IGC TRADE	-19.91	-40.89
IGC - NM	-15.87	-27.76
ISE	-10.46	-18.92

*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

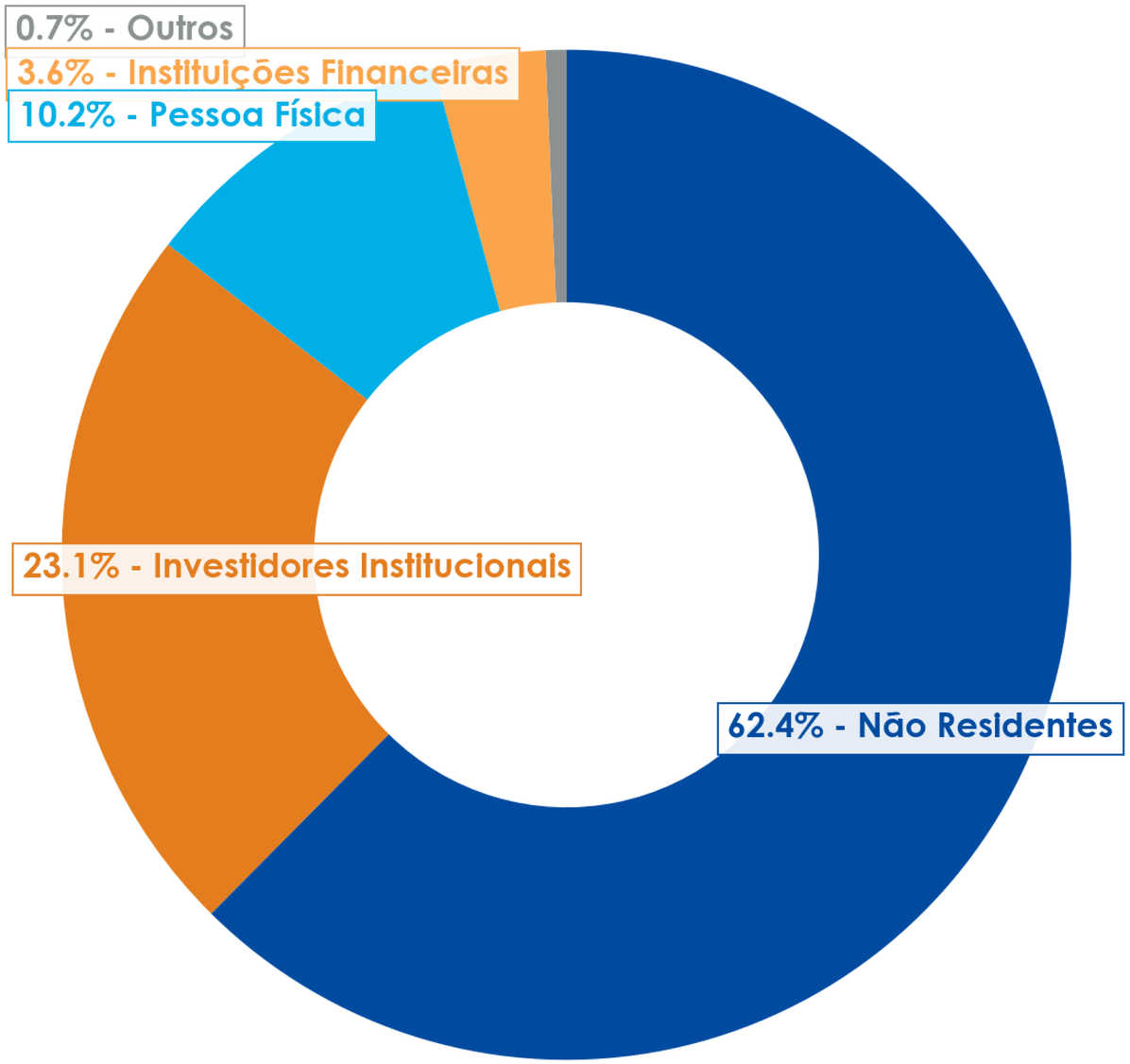


Composição ISE - TOP 15 Ativos

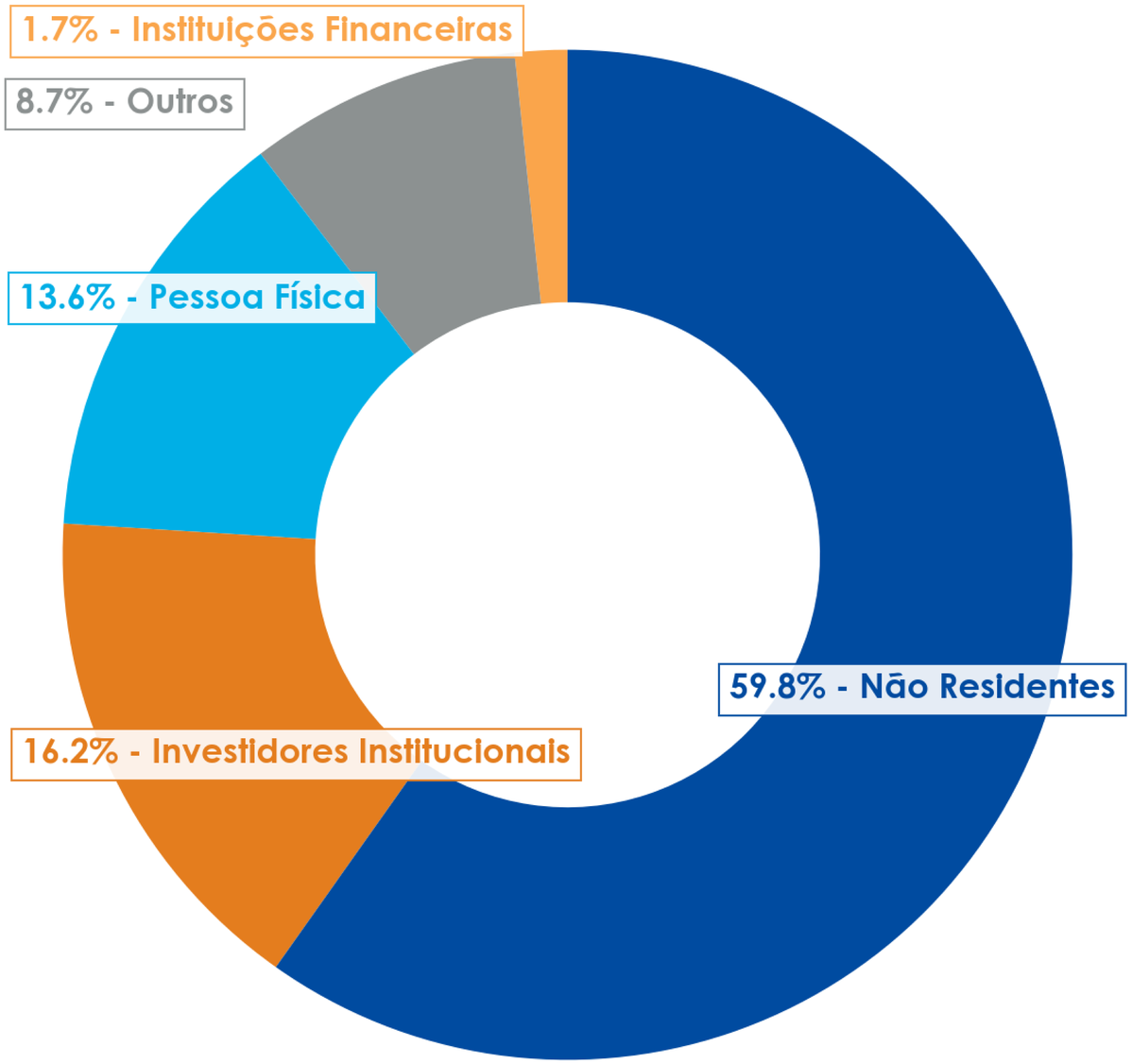
Ticker	Setor Econômico	% Mercado
EGIE3	Utilidade Pública	2.47
BRFS3	Consumo Não Cíclico	2.27
RDOR3	Saúde	2.25
CPLE6	Utilidade Pública	2.25
KLBN11	Materiais Básicos	2.20
VIVT3	Comunicação	2.19
RADL3	Saúde	2.17
TRPL4	Utilidade Pública	2.16
ITSA4	Financeiro	2.15
CCRO3	Bens Industriais	2.15
CMIG4	Utilidade Pública	2.15
B3SA3	Financeiro	2.14
TIMS3	Comunicação	2.14
BBAS3	Financeiro	2.14
SANB11	Financeiro	2.13

Participação por Tipo Investidor*

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



Participação na posição em custódia (R$) – May/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
EGIE3	Utilidade Pública	9.04	8.97	43.34	18.05	91.72	2.47
BRFS3	Consumo Não Cíclico	10.07	128.54	18.58	46.84	73.14	2.27
RDOR3	Saúde	5.62	-3.43	27.46	34.45	69.94	2.25
CPLE6	Utilidade Pública	-0.11	30.38	9.08	21.86	61.75	2.25
KLBN11	Materiais Básicos	-1.73	12.20	20.32	20.47	77.30	2.20
VIVT3	Comunicação	-8.53	15.06	43.30	21.27	94.16	2.19
RADL3	Saúde	-1.99	-10.52	25.07	23.38	84.68	2.17
TRPL4	Utilidade Pública	0.64	12.43	25.13	24.35	135.13	2.16
ITSA4	Financeiro	1.78	27.64	9.73	18.17	72.53	2.15
CCRO3	Bens Industriais	-2.35	-8.20	12.04	21.04	66.14	2.15
CMIG4	Utilidade Pública	1.84	24.29	9.95	25.52	81.93	2.15
B3SA3	Financeiro	-0.83	-16.95	10.70	30.21	67.98	2.14
TIMS3	Comunicação	-9.94	21.70	15.86	22.10	91.89	2.14
BBAS3	Financeiro	-1.09	33.28	27.12	20.23	62.07	2.14
SANB11	Financeiro	-3.98	2.73	27.75	21.67	77.39	2.13
ITUB4	Financeiro	-1.00	26.81	31.03	18.78	68.02	2.11

*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
BPAC11	Financeiro	-5.42	22.90	31.59	0.00	-	2.08
RAIL3	Bens Industriais	-1.78	-4.90	19.71	25.35	80.50	2.05
BBDC4	Financeiro	-9.38	-12.58	12.67	27.44	77.34	2.05
LREN3	Consumo Cíclico	-14.42	-29.65	13.12	42.39	86.99	2.05
CSAN3	Petróleo e Gás	-6.07	-9.20	13.62	28.08	76.74	2.00
ENEV3	Utilidade Pública	0.40	8.56	12.43	27.63	85.83	1.99
ELET3	Utilidade Pública	-8.11	-0.38	34.79	27.18	84.75	1.98
ALOS3	Financeiro	6.12	2.25	20.97	23.98	-	1.97
NTCO3	Consumo Não Cíclico	-10.49	11.37	14.85	38.28	59.89	1.91
WEGE3	Bens Industriais	-5.06	1.74	37.55	24.68	80.31	1.90
SUZB3	Materiais Básicos	-16.70	11.30	48.70	25.41	84.19	1.88
VBBR3	Petróleo e Gás	-8.18	42.97	21.54	30.38	77.72	1.81
ASAI3	Consumo Não Cíclico	-7.16	13.30	12.18	42.20	111.08	1.79
ABEV3	Consumo Não Cíclico	-4.86	-15.58	11.56	19.31	85.03	1.76
HYPE3	Saúde	-7.73	-30.84	27.15	31.41	104.18	1.74
CPFE3	Utilidade Pública	6.90	25.03	34.10	19.41	65.05	1.62

*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
STBP3	Bens Industriais	-14.48	23.64	11.51	32.69	76.74	1.60
CIEL3	Financeiro	0.54	29.98	5.60	30.65	76.49	1.56
UGPA3	Petróleo e Gás	-10.37	40.66	23.17	25.47	66.94	1.51
ENAT3	Petróleo e Gás	-18.96	73.38	22.14	43.56	96.16	1.47
SAPR11	Utilidade Pública	6.14	43.69	27.31	23.80	78.99	1.43
PSSA3	Financeiro	1.30	35.13	30.35	23.23	81.65	1.40
CRFB3	Consumo Não Cíclico	-11.19	5.52	9.92	45.36	111.97	1.35
CYRE3	Consumo Cíclico	-5.86	6.88	19.11	34.92	72.72	1.30
IGTI11	Financeiro	-3.20	-3.97	20.25	24.84	70.09	1.13
MGLU3	Consumo Cíclico	-8.90	-67.19	12.39	69.04	82.27	1.08
VAMO3	Consumo Cíclico	14.06	-34.92	8.11	47.19	96.33	1.05
USIM5	Materiais Básicos	-4.30	11.55	7.57	31.00	69.68	1.02
CSMG3	Utilidade Pública	2.91	20.26	20.15	27.90	72.92	0.97
NEOE3	Utilidade Pública	-1.46	23.02	18.90	25.25	95.10	0.95
SRNA3	Utilidade Pública	5.72	-11.78	8.69	38.43	-	0.95
YDUQ3	Consumo Cíclico	-17.00	-11.30	12.11	53.73	78.45	0.93

*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
AURE3	Utilidade Pública	3.02	-2.70	11.94	15.74	59.49	0.92
AESB3	Utilidade Pública	18.27	-7.30	11.20	25.82	109.92	0.90
SLCE3	Consumo Não Cíclico	-2.41	8.22	17.82	24.28	74.87	0.89
RAIZ4	Petróleo e Gás	-6.86	-17.47	2.85	33.78	68.55	0.88
COGN3	Consumo Cíclico	-14.29	-35.64	1.86	44.62	85.69	0.88
FLRY3	Saúde	-2.97	-1.93	14.05	22.52	59.08	0.87
ARZZ3	Consumo Cíclico	-4.85	-31.04	49.40	39.53	94.73	0.79
AZUL4	Bens Industriais	-2.87	-43.80	9.47	56.40	66.76	0.79
BPAN4	Financeiro	-0.11	43.29	9.13	35.29	75.94	0.76
SOMA3	Consumo Cíclico	-2.80	-43.00	5.90	47.99	89.97	0.75
MRVE3	Consumo Cíclico	3.28	-31.35	6.92	49.30	82.80	0.67
ECOR3	Bens Industriais	-2.38	11.73	6.89	34.93	67.92	0.59
DXCO3	Materiais Básicos	-0.41	-15.78	7.20	40.82	83.05	0.55
MDIA3	Consumo Não Cíclico	-7.63	-17.40	31.35	28.18	58.68	0.54
GRND3	Consumo Cíclico	4.38	-6.57	6.18	25.36	71.78	0.42
BEEF3	Consumo Não Cíclico	1.31	-38.19	6.20	39.58	90.99	0.42

*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
CBAV3	Materiais Básicos	37.72	37.08	7.12	48.56	81.72	0.38
MYPK3	Consumo Cíclico	-12.85	-16.36	10.72	32.22	78.20	0.36
SIMH3	Financeiro	4.33	-34.74	6.03	42.55	82.05	0.35
PCAR3	Consumo Não Cíclico	-2.05	-57.44	2.87	69.81	144.50	0.30
CEAB3	Consumo Cíclico	-12.79	108.91	9.61	66.61	88.55	0.26
RANI3	Materiais Básicos	-5.43	9.90	8.48	32.07	96.16	0.23
CAML3	Consumo Não Cíclico	14.90	43.02	9.57	35.45	73.41	0.23
MOVI3	Consumo Cíclico	-8.22	-36.53	6.48	48.15	81.05	0.21
JSLG3	Bens Industriais	-9.25	32.23	10.50	39.80	81.76	0.16
GUAR3	Consumo Cíclico	4.59	65.32	7.56	64.92	97.40	0.16
DASA3	Saúde	-27.23	-68.22	3.42	66.68	107.62	0.13
AMBP3	Utilidade Pública	-19.30	-61.28	8.07	48.32	89.81	0.11
GFSA3	Consumo Cíclico	-20.69	-1.60	4.14	110.38	91.07	0.09
MTRE3	Consumo Cíclico	-10.70	-27.41	3.68	56.16	103.06	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