

Idex

Idex-CDI

Junho 2023

Este material foi elaborado pela JGP, tem caráter meramente informativo e não deve ser utilizado, distribuído ou copiado sem a prévia e expressa autorização da JGP,

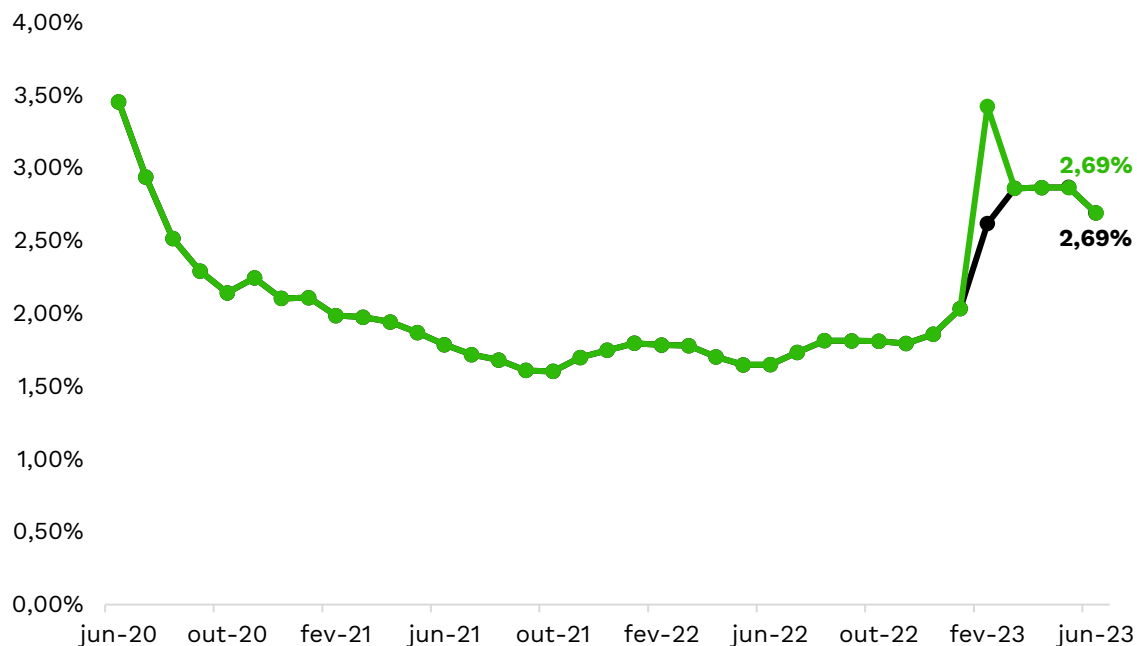
JGP

Idex-CDI JGP

Comentário Mensal — Junho

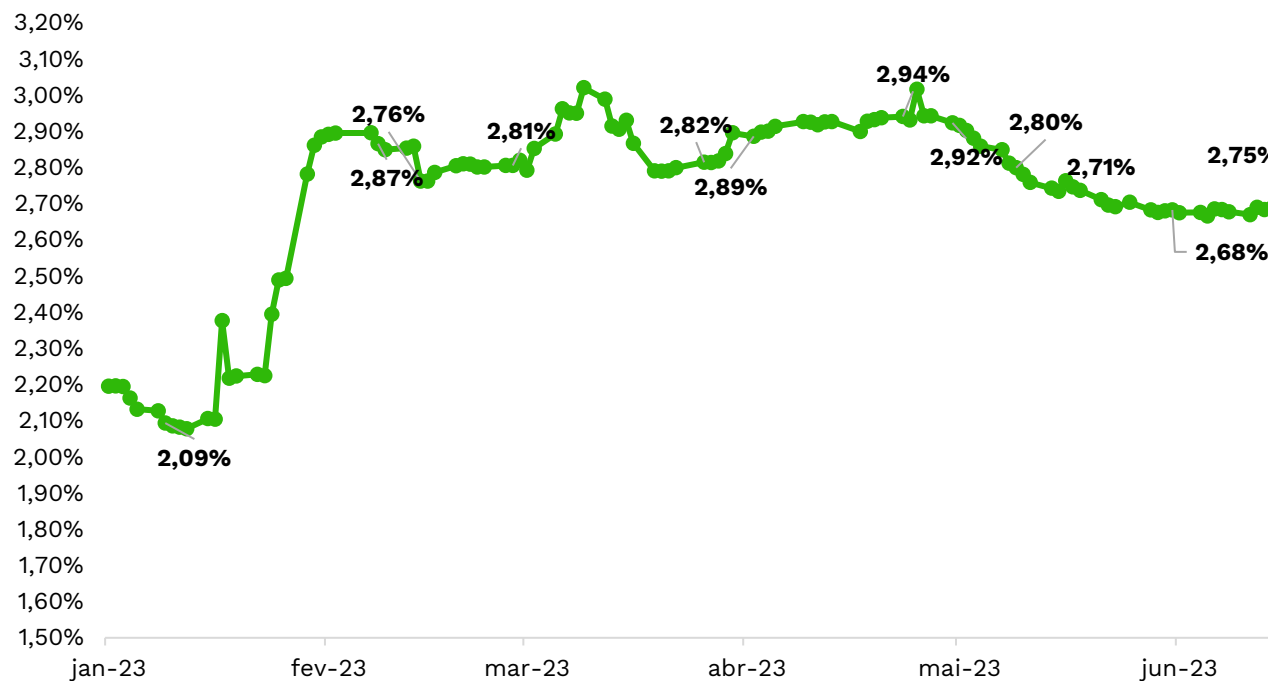
Comentário Mensal

Evolução do *spread* médio mensal do Idex-CDI
(ex-Lame e ex-Light)



● Idex BID Spread DI+ ex-Light e ex-Lame ● Idex BID Spread DI+ ex-Lame

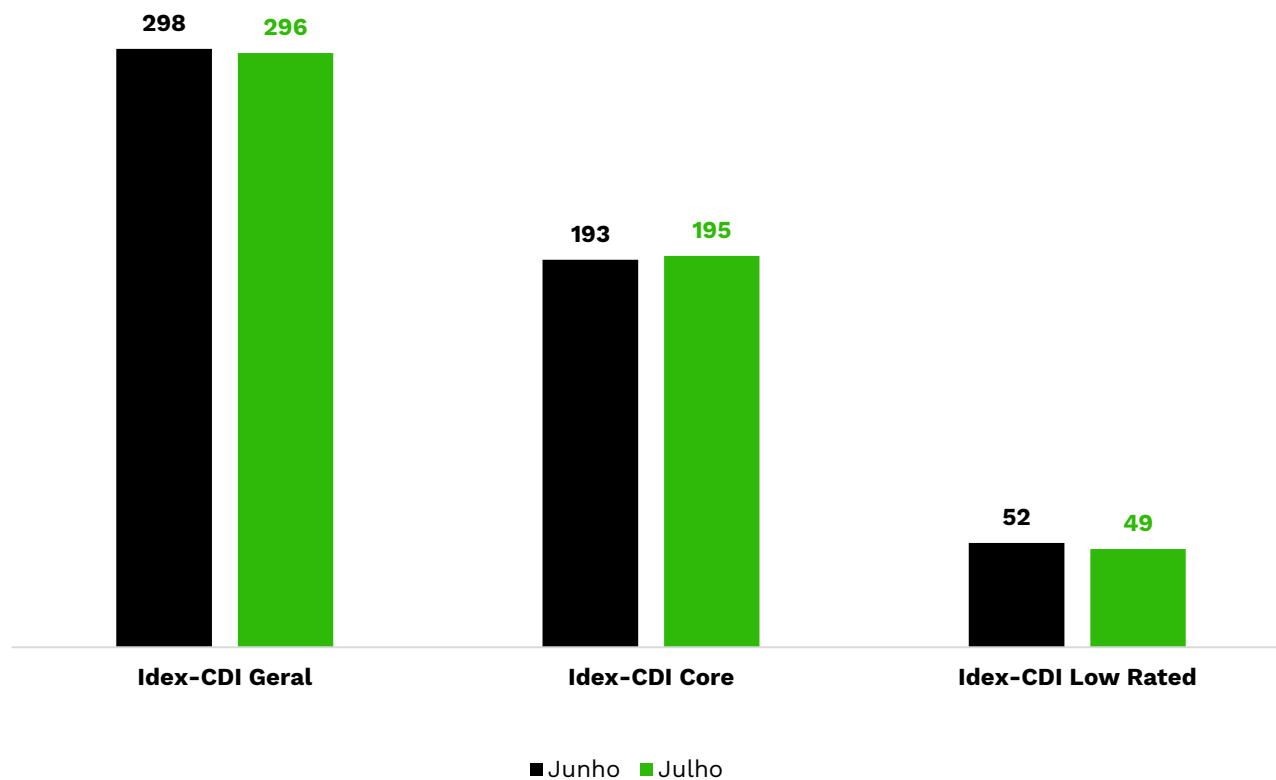
Evolução do *spread* diário do Idex-CDI (ex-Lame e Light)



● Idex BID spread (ex-Lame e ex-Light)

Nova Amostra

Alterações na Amostra



Alterações no Índice - Idex-CDI Geral (30-Jun — 03-Jul)

Ingressaram no
Idex-CDI (6)

Saíram do Idex-
CDI (8)

ALSO25	ANIM12
BRKMA8	CSBR11
EEEL28	EATE19
ENAT21	ESCEA2
RDORB7	PRLG14
XVII11	RDCO29
	RIS411
	RLOG11

Destques de performance

Maiores aberturas de spread %DI

Ativo	01-Jun	30-Jun	Dif
SULM16	116,5%	118,0%	1,5%
MULP16	111,5%	112,0%	0,5%
ALSCA0	110,0%	110,0%	0,0%

Maiores fechamentos de spread %DI

Ativo	01-Jun	30-Jun	Dif
CEEBB2	120,0%	118,0%	-2,0%
UNDAC1	118,0%	116,0%	-2,0%
CPGT16	111,5%	110,0%	-1,5%

Maiores aberturas de spread DI+

Ativo	01-Jun	30-Jun	Dif
HSPA12	6,9%	13,0%	6,1%
CBRDB8	6,3%	8,5%	2,3%
CBRDA8	6,0%	7,5%	1,5%

Maiores fechamentos de spread DI+

Ativo	01-Jun	30-Jun	Dif
MOVI27	5,0%	3,8%	-1,2%
DASAB4	4,5%	3,4%	-1,1%
SBFC13	6,0%	5,0%	-1,0%

Rentabilidade do Idex-CDI Geral (12 meses)

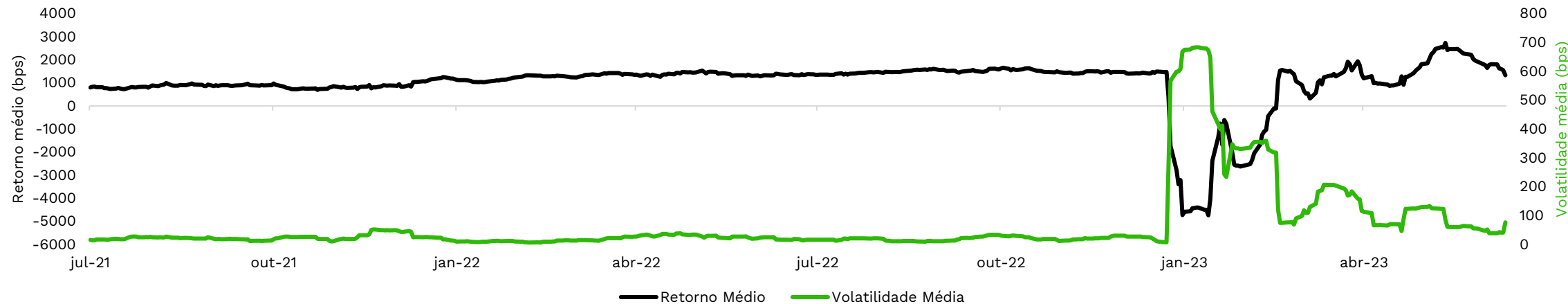
Mês	%DI	DI+	CDI
06/2023	1,39%	1,25%	1,07%
05/2023	1,45%	1,81%	1,12%
04/2023	0,90%	0,77%	0,92%
03/2023	1,19%	1,15%	1,17%
02/2023	-0,06%	-1,22%	0,92%
01/2023	0,89%	0,67%	1,12%
12/2022	1,27%	1,28%	1,12%
11/2022	1,16%	1,16%	1,02%
10/2022	1,19%	1,29%	1,02%
09/2022	1,23%	1,30%	1,07%
08/2022	1,32%	1,39%	1,17%
07/2022	1,09%	1,09%	0,99%
Total	13,81%	12,57%	13,49%

Idex-CDI JGP

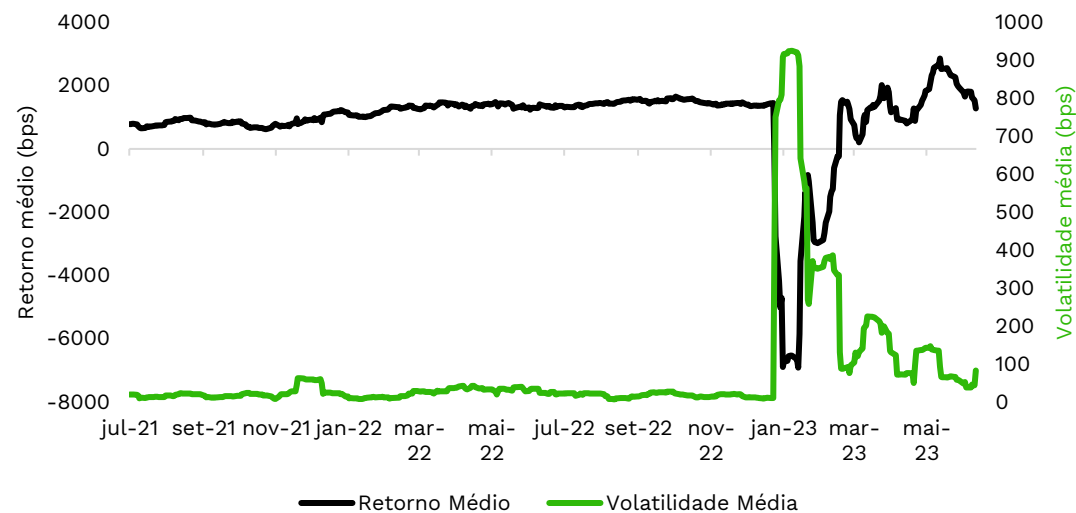
Gráficos e Tabelas

Retorno médio X Volatilidade Média Anualizados (janela móvel 15 dias)

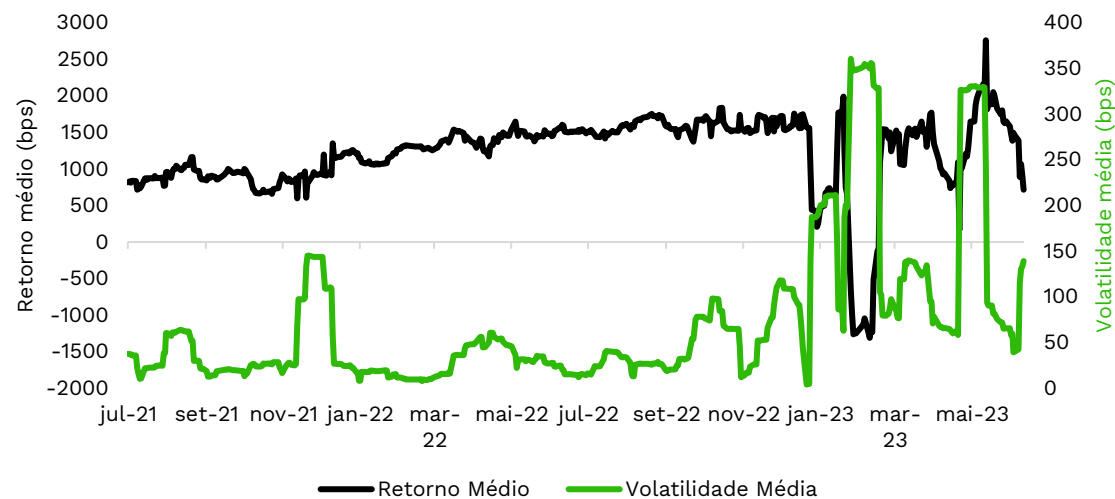
I dex-CDI Geral



I dex-CDI Core

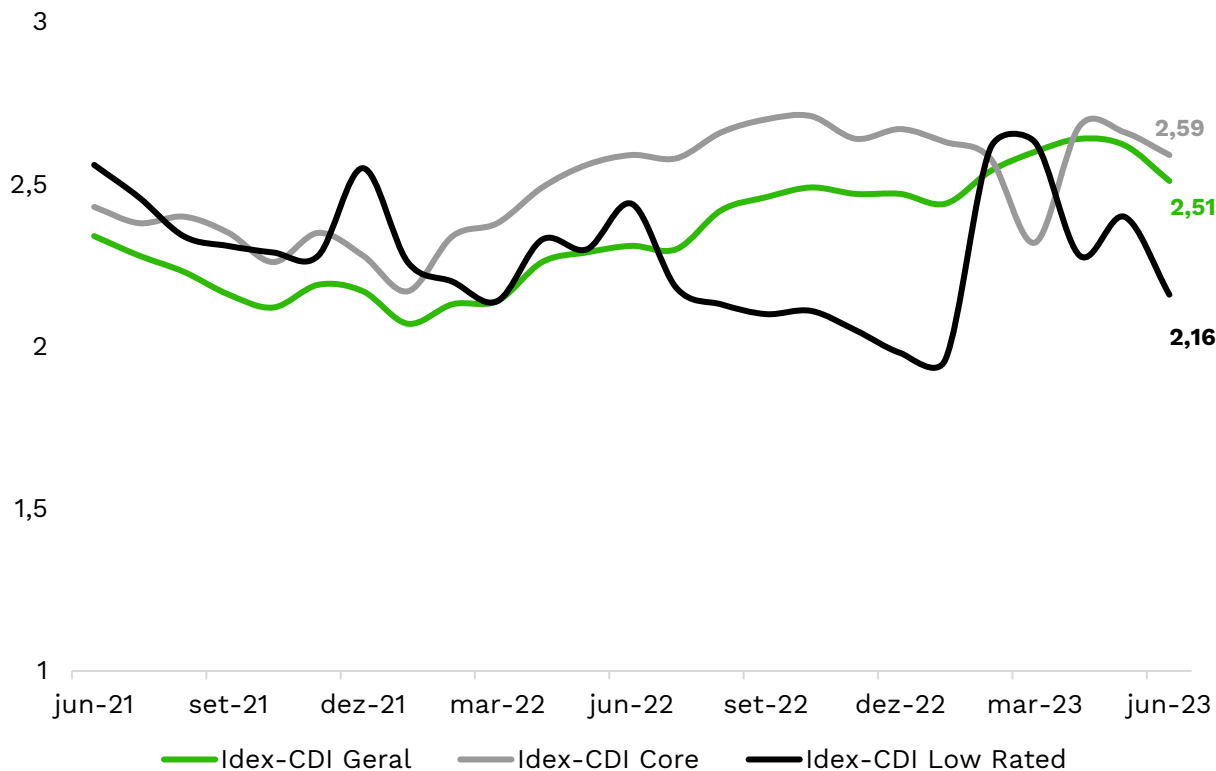


I dex-CDI Low Rated

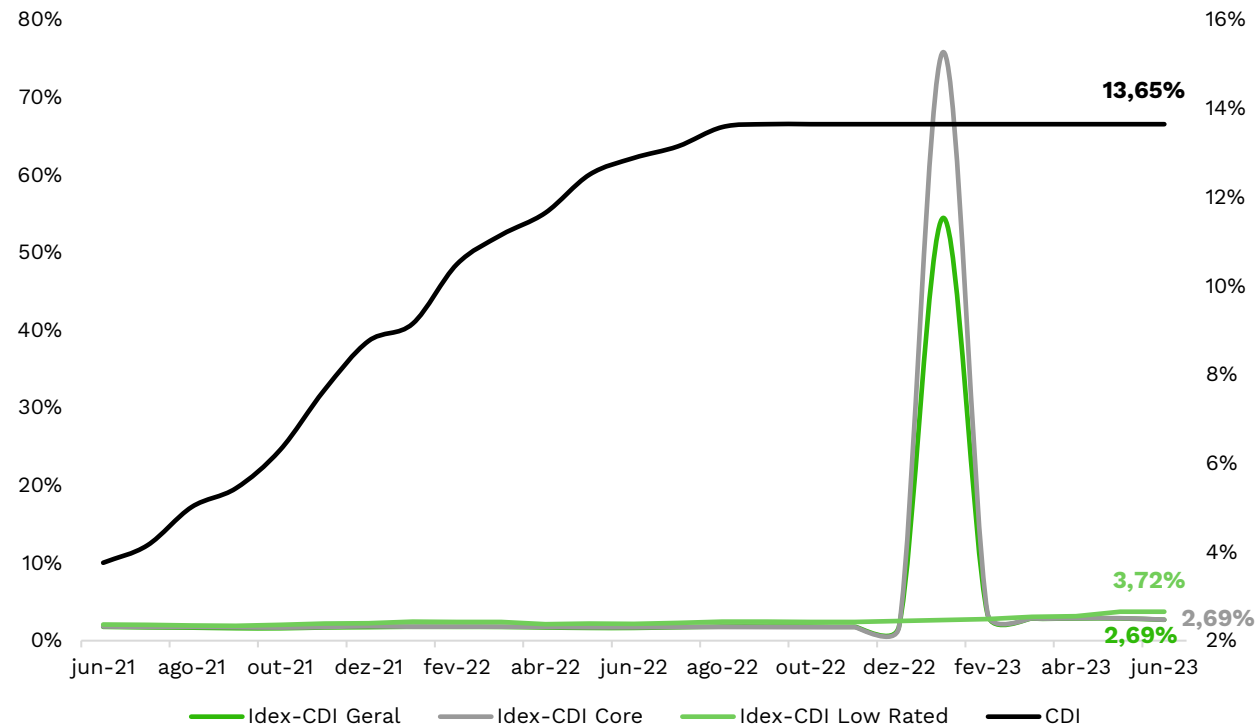


Duration e Spread

Duration to Maturity Ponderada (em anos)



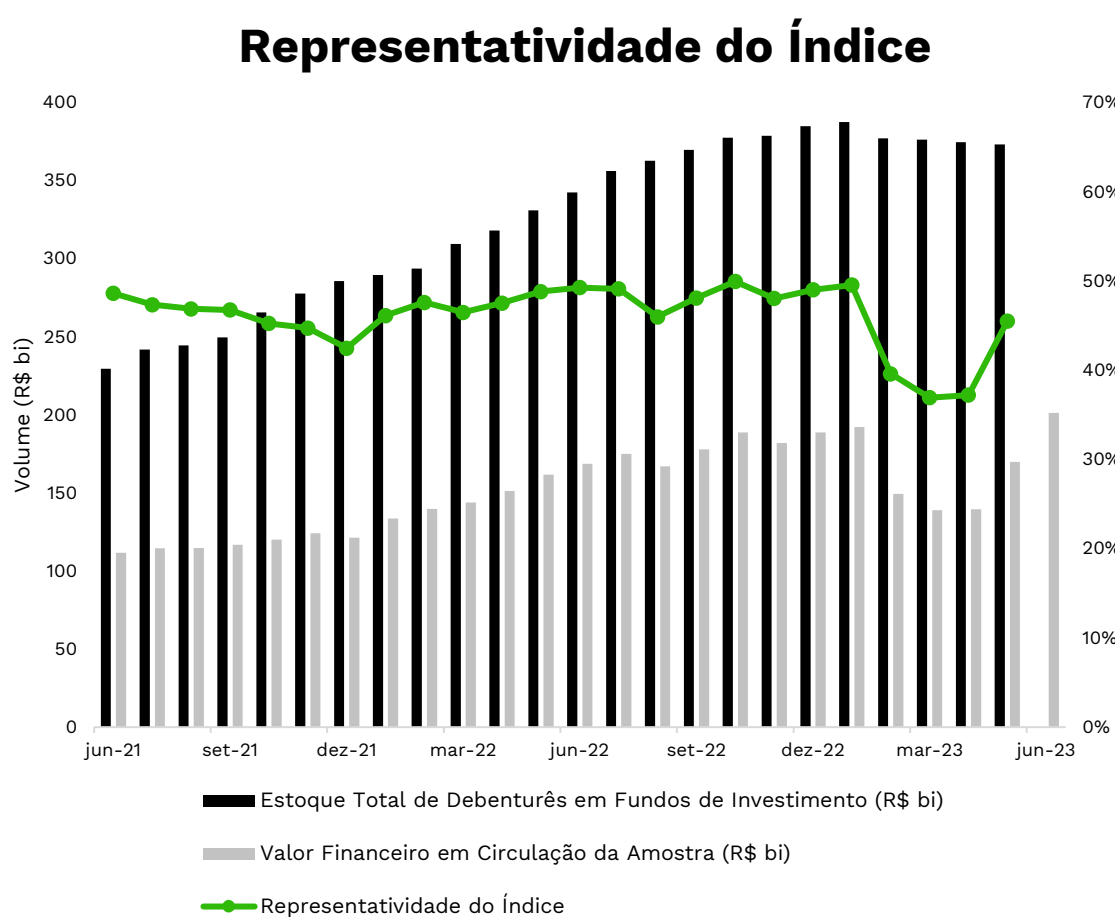
Evolução dos Spreads de Carregos Médios Ponderados (em CDI+)



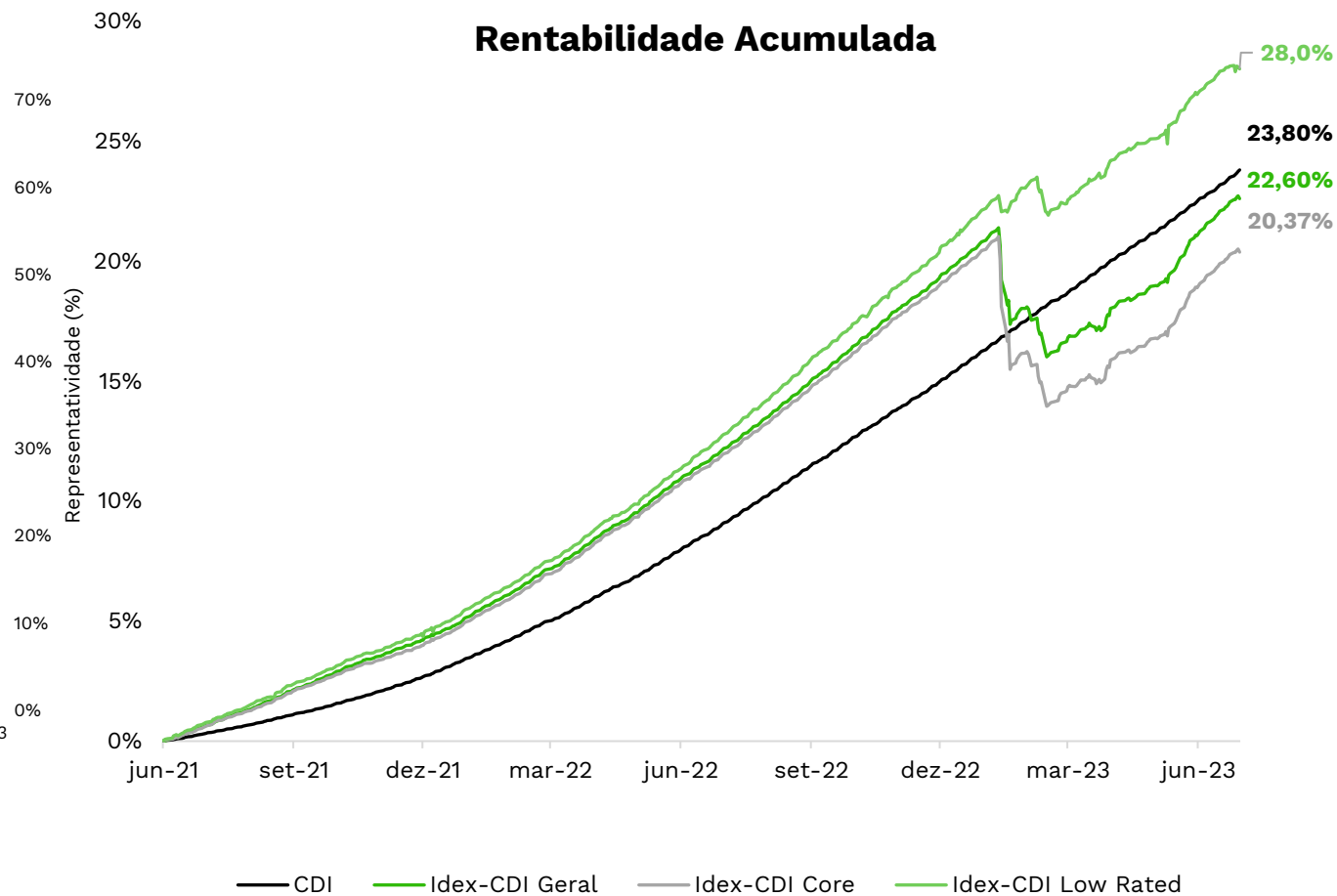
Fonte: JGP

Idex-CDI Geral

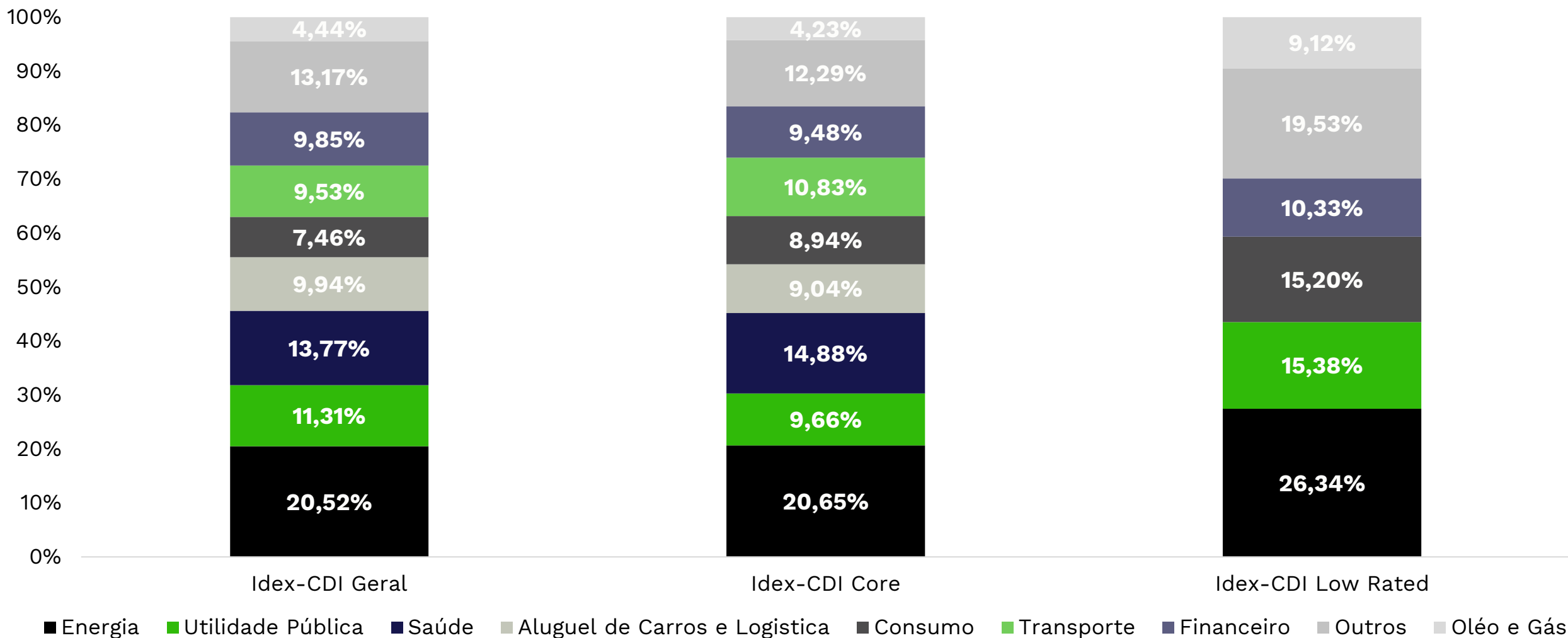
Representatividade do Índice



Rentabilidade Acumulada



Exposição por Setor (30/06/23)

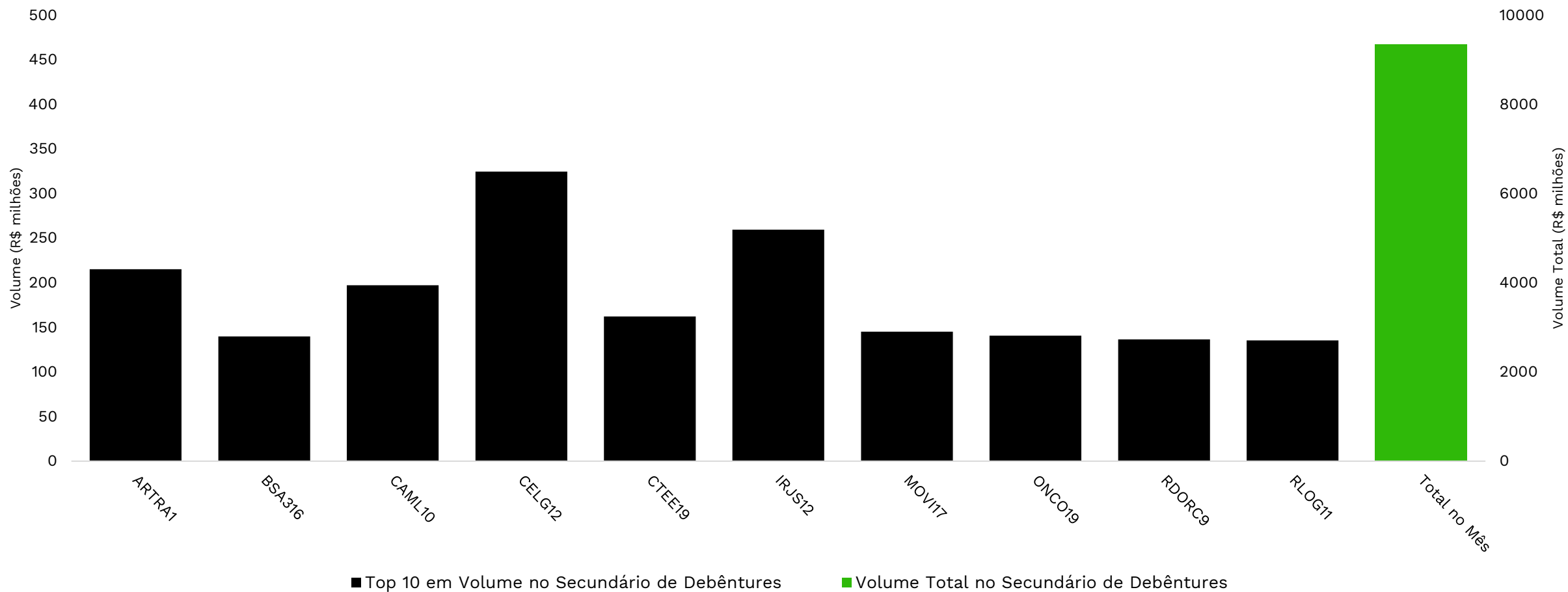


Fonte: JGP

Histórico de Performance

Ano		Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Acum Ano
2023	Idex-CDI Geral	-2,24 %	-1,22 %	1,17 %	0,77 %	1,79 %	1,27 %							1,48 %
	Idex-CDI Core	-3,49 %	-1,41 %	1,13 %	0,75 %	1,83 %	1,25 %							-0,05 %
	Idex-CDI Low Rated	0,83 %	-0,61 %	1,47 %	0,73 %	1,48 %	0,84 %							4,82 %
	CDI	1,12 %	0,92 %	1,17 %	0,92 %	1,12 %	1,07 %							6,50 %
2022	Idex-CDI Geral	0,91 %	0,98 %	1,15 %	1,05 %	1,26 %	1,12 %	1,14 %	1,38 %	1,29 %	1,27 %	1,16 %	1,28 %	14,90 %
	Idex-CDI Core	0,89 %	0,98 %	1,16 %	1,07 %	1,24 %	1,11 %	1,11 %	1,35 %	1,29 %	1,27 %	1,14 %	1,23 %	14,74 %
	Idex-CDI Low Rated	0,91 %	0,97 %	1,18 %	1,04 %	1,32 %	1,26 %	1,21 %	1,54 %	1,31 %	1,30 %	1,22 %	1,47 %	15,77 %
	CDI	0,73 %	0,76 %	0,93 %	0,83 %	1,03 %	1,02 %	1,03 %	1,17 %	1,07 %	1,02 %	1,02 %	1,12 %	12,39 %
2021	Idex-CDI Geral	0,58 %	0,67 %	0,62 %	0,49 %	0,54 %	0,62 %	0,66 %	0,82 %	0,73 %	0,64 %	0,67 %	0,90 %	8,23 %
	Idex-CDI Core	0,70 %	0,77 %	0,55 %	0,42 %	0,53 %	0,59 %	0,65 %	0,80 %	0,67 %	0,58 %	0,62 %	0,94 %	8,12 %
	Idex-CDI Low Rated	0,76 %	0,93 %	0,48 %	0,37 %	0,70 %	0,75 %	0,70 %	0,89 %	0,72 %	0,64 %	0,70 %	0,97 %	8,95 %
	CDI	0,15 %	0,13 %	0,20 %	0,20 %	0,27 %	0,31 %	0,36 %	0,43 %	0,44 %	0,49 %	0,59 %	0,77 %	4,42 %

Volume no Secundário das Debêntures da Amostra (01/06/23 a 30/06/23) em R\$ milhões



Fonte: JGP

Idex-CDI Geral — Tabelas de Atribuição de Performance

- Variação total: carregos + marcação a mercado
- Variações de carregos: retorno obtido por carregar o papel em sua taxa de indicativa
- Variações de marcação a mercado: reflete ganhos/perdas no preço das debênture referentes a fechamento/abertura das taxas indicativas

5 Melhores variações no período

Ativo	Empresa	Variação	% DI
DASAB4	Dasa	4,67%	435,42%
IOCH29	lochpe	4,28%	934,22%
SBFC13	Centauro	3,90%	363,52%
MRVEA8	Mrv	2,76%	257,19%
HZTC24	Orizon Meio Ambiente	2,38%	222,18%
Idex-CDI Geral		1,27%	118,34%

5 Piores variações no período

Ativo	Empresa	Variação	% DI
HSPA12	Hospital Anchieta S.A.	-13,18%	-1229,75%
CBRDB8	Cbd	-5,21%	-485,60%
DASAB5	Dasa	-2,51%	-234,08%
CBRDA8	Cbd	-1,33%	-124,21%
MGLUA0	Magazine Luiza S.A.	-0,66%	-61,62%
Idex-CDI Geral		1,27%	118,34%

5 Melhores variações de carregos no período

Ativo	Empresa	Carrego	% DI
ELFA12	Elfa Medicamentos	2,14%	200,02%
HSPA12	Hospital Anchieta S.A.	1,74%	162,73%
AERI12	Aeris	1,70%	158,67%
GUAR23	Guararapes Confeccoes	1,69%	157,76%
AERI11	Aeris	1,69%	157,67%
Idex-CDI Geral		1,30%	121,00%

5 Piores variações de carregos no período

Ativo	Empresa	Carrego	% DI
CMGD17	Cemig Distribuicao	1,17%	108,80%
SNGO16	Saneago	1,17%	109,51%
ECOV14	Ecovias Dos Imigrantes	1,18%	109,66%
ALSCA0	Aliansce Sonae	1,18%	110,10%
NCFP14	Ncf Participações	1,18%	110,19%
Idex-CDI Geral		1,30%	121,00%

5 Melhores variações a mercado no período

Ativo	Empresa	MTM	% DI
IOCH29	lochpe	3,71%	810,93%
DASAB4	Dasa	3,29%	307,21%
SBFC13	Centauro	2,38%	222,02%
MRVEA8	Mrv	1,37%	127,53%
NATUA1	Natura	1,07%	99,50%
Idex-CDI Geral		-0,03%	-2,63%

5 Piores variações a mercado no período

Ativo	Empresa	MTM	% DI
HSPA12	Hospital Anchieta S.A.	-14,69%	-1370,05%
CBRDB8	Cbd	-6,71%	-625,48%
DASAB5	Dasa	-3,78%	-353,07%
CBRDA8	Cbd	-2,89%	-269,78%
MGLUA0	Magazine Luiza S.A.	-2,26%	-210,50%
Idex-CDI Geral		-0,03%	-2,63%

Idex

JGP

Gestão e Distribuição

JGP Gestão de Recursos Ltda.
e JGP Gestão de Crédito Ltda.

Rio de Janeiro - RJ — Brasil

Rua Humaitá 275, 11º e 12º andares
Humaitá, Rio de Janeiro - RJ
CEP: 22261-005
Telefone +55 21 3528.8200

São Paulo - SP — Brasil

Av. Brigadeiro Faria Lima, 2277
Cj. 1904, 19º andar – Jd. Paulistano
São Paulo – SP — Brasil
CEP: 01452-000
Telefone +55 11 4878.0001

www.jgp.com.br

Este material é meramente informativo e não considera os objetivos de investimento, a situação financeira ou as necessidades individuais de um ou de determinado grupo de investidores. Recomendamos a consulta de profissionais especializados para decisão de investimentos. Fundos de Investimento não contam com a Garantia do Administrador, do Gestor, de qualquer mecanismo de seguro, ou, ainda, do Fundo Garantidor de Crédito – FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto ou do regulamento do Fundo de Investimento antes de aplicar seus recursos. **Descrição do tipo ANBIMA disponível no formulário de informações complementares.** As rentabilidades divulgadas são líquidas de taxa de administração e performance e bruta de impostos. As informações e conclusões contidas neste material podem ser alteradas a qualquer tempo, sem que seja necessária prévia comunicação. Este material não pode ser copiado, reproduzido ou distribuído sem a prévia e expressa concordância da JGP. Para maiores informações, consulte nossa área comercial.

Signatory of:



Gestão de Recursos