

Idex

Idex-Infra

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,

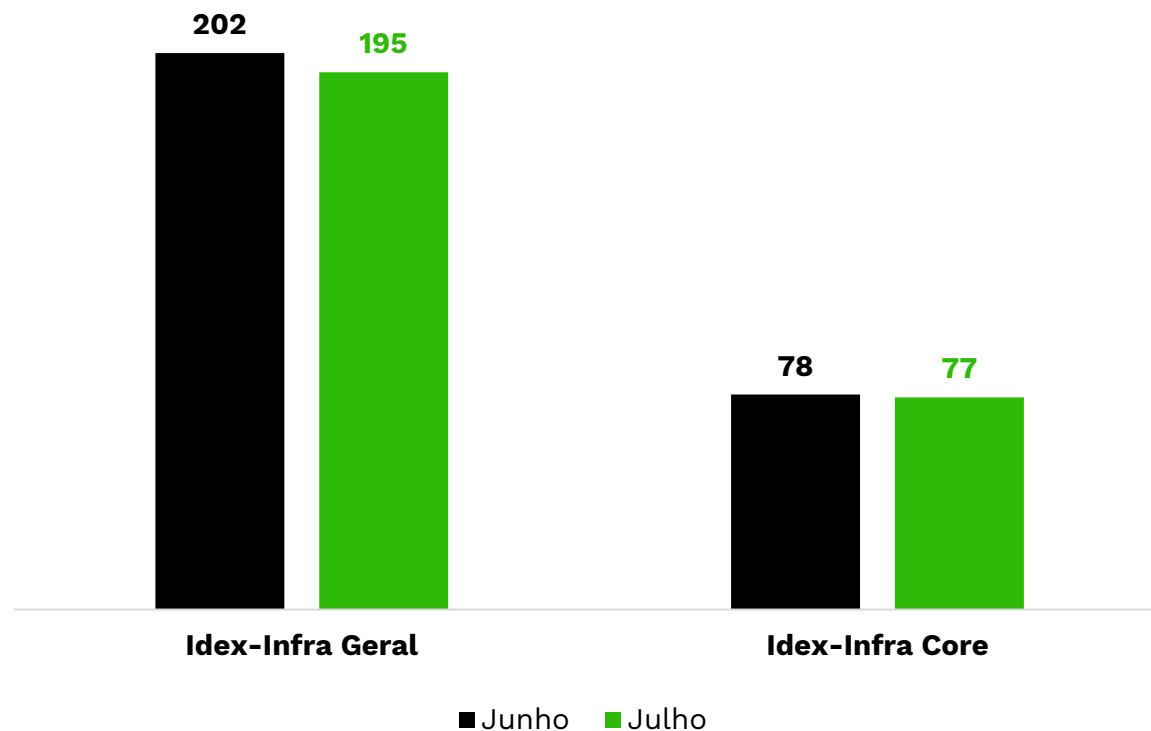
JGP

Idex-Infra JGP

Comentário Mensal — Junho

Nova Amostra

Alterações nas Amostras



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

Ingressaram no Idex-Infra (5)	Saíram do Idex-Infra (12)
ASCP23	AEAB11
EKTRC1	ALGA26
JALL21	CMIN12
TAEAA2	CTEE15
TIMS12	CTEE17
	CTEE29
	EDPA11
	ELEK37
	ENEV13
	ITGT11
	MOBP12
	PETR16

Destques de performance

Idex-Infra Geral

Maiores aberturas de spread (bps over B-ref)

Ativo	01-Jun	30-Jun	Dif
ANET11	426,4	487,1	61
CMGD27	10,2	65,9	56
CSNP12	130,7	178,9	48
CPTM15	423,8	466,9	43
NTEN11	333,8	351,9	18

Maiores fechamentos de spread (bps over B-ref)

Ativo	01-Jun	30-Jun	Dif
CART12	95,1	-47,3	-142
FGEN13	108,2	36,5	-72
NRTB21	78,9	14,9	-64
PASN12	315,2	252,8	-62
SAPRA3	143,6	83	-61

Idex-Infra Core

Maiores aberturas de spread (bps over B-ref)

Ativo	01-Jun	30-Jun	Dif
CMGD27	10,2	65,9	56
PETR27	64,4	74,6	10
CTEE15	43,3	50,9	8
EGIE29	90,8	97,3	6
ARTR19	140,6	146,8	6

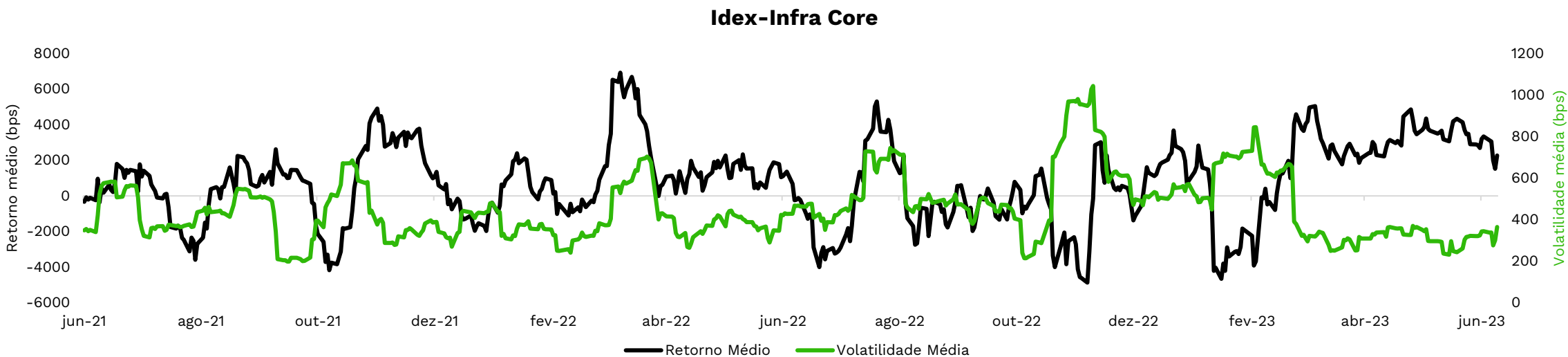
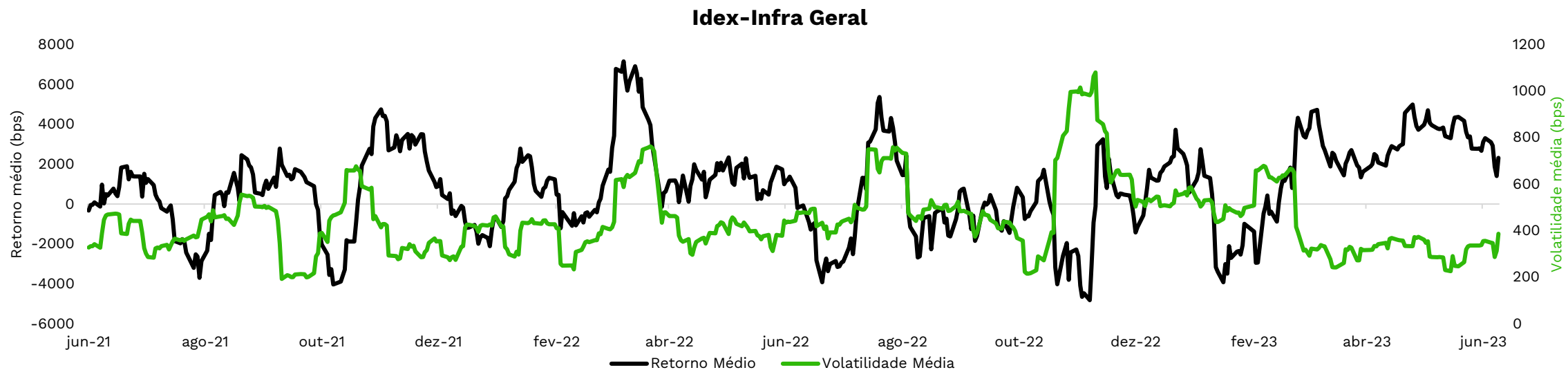
Maiores fechamentos de spread (bps over B-ref)

Ativo	01-Jun	30-Jun	Dif
CART12	95,1	-47,3	-142
VPLT12	171	112,9	-58
CMIN11	163,7	126,3	-37
CGMG18	132,7	98,6	-34
APFD19	201	167	-34

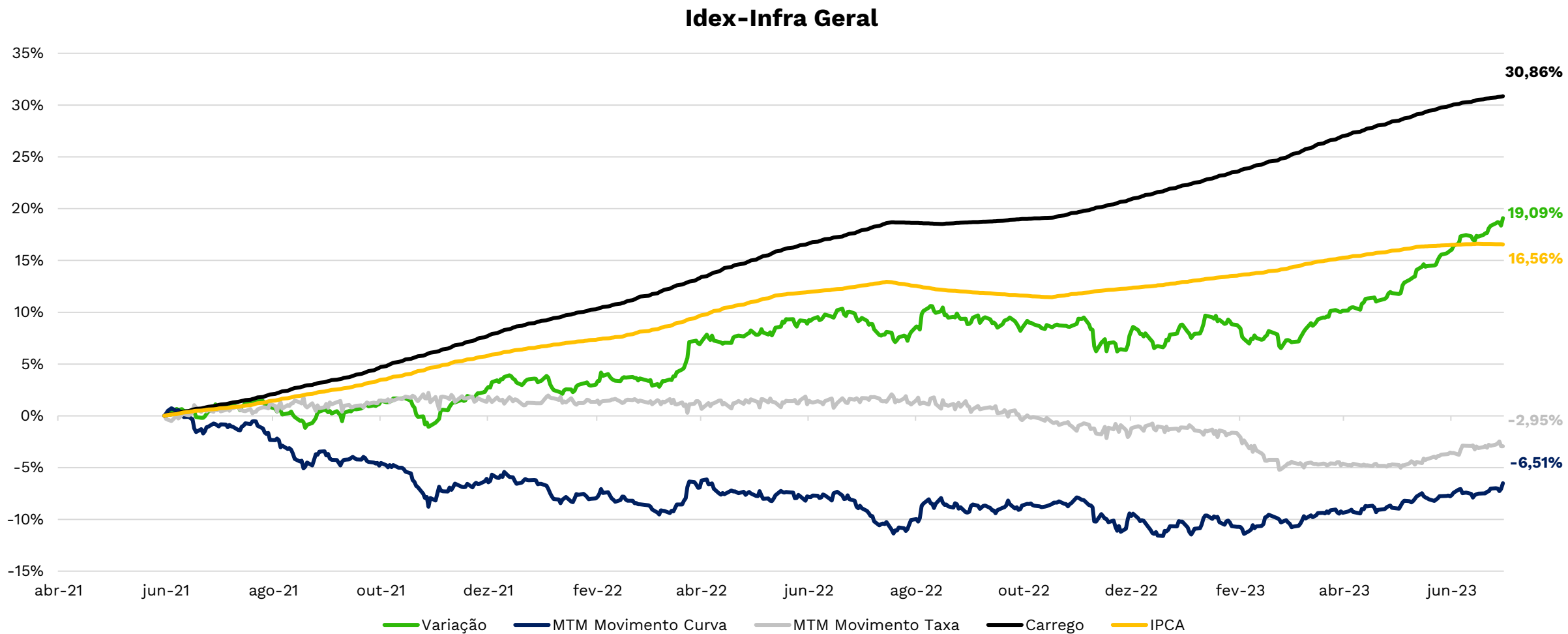
Idex- Infra JGP

Gráficos e Tabelas

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



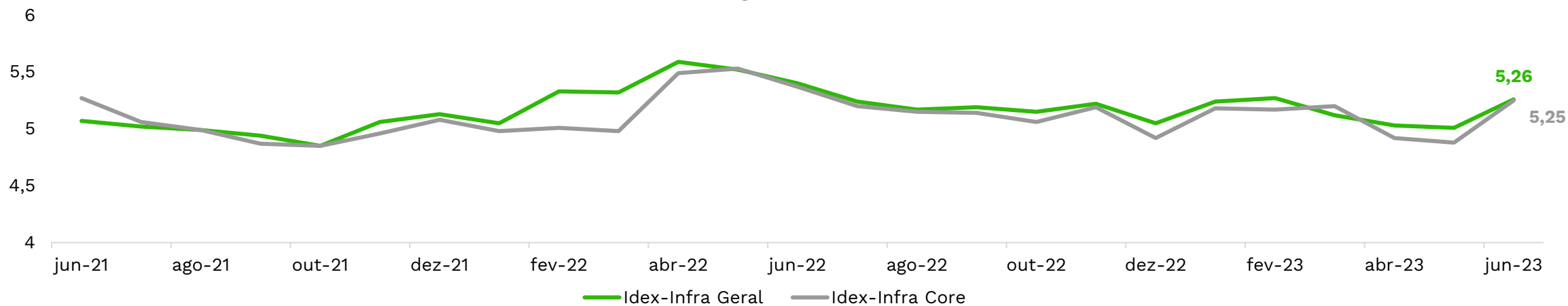
Rentabilidade Acumulada (2 anos)



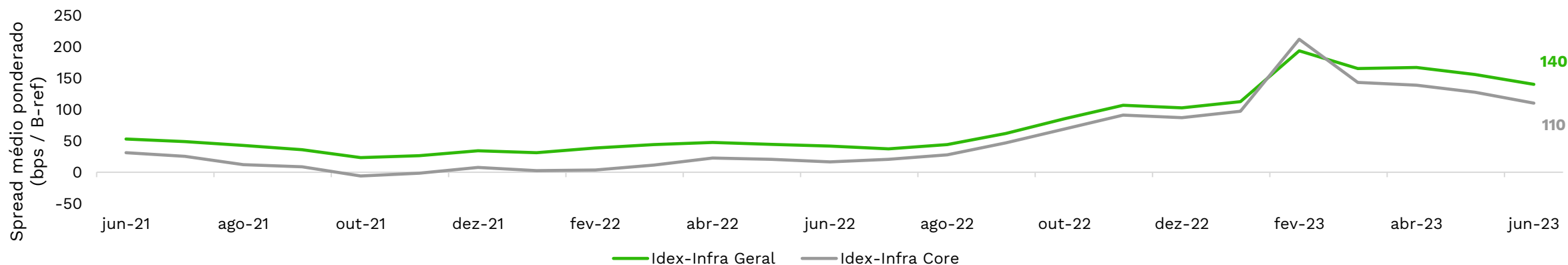
Fonte: JGP

Duration e Spread

Duration to Maturity Ponderada (em anos)

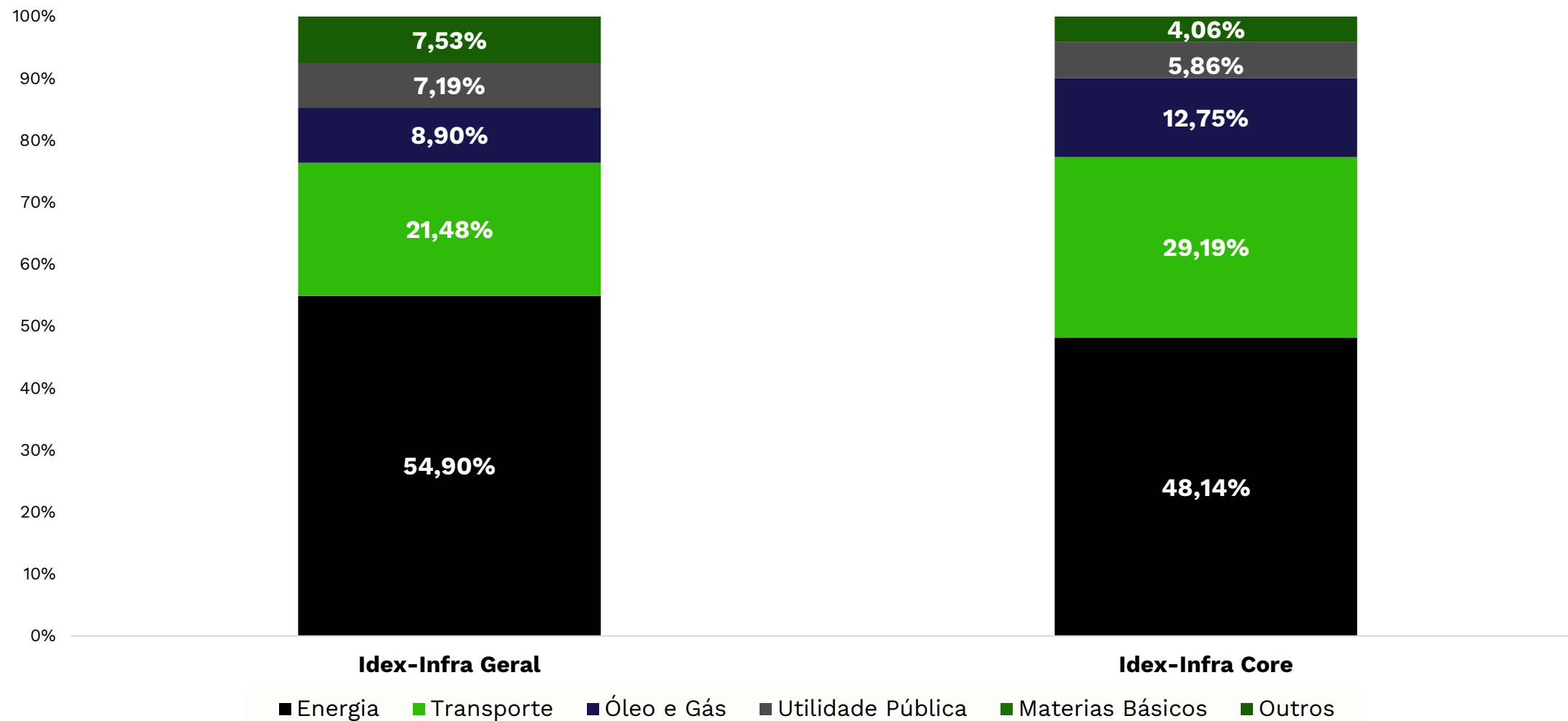


Evolução mensal dos spreads médios: Idex - Infra Geral e Idex - Infra Core (em IPCA+)



Fonte: JGP

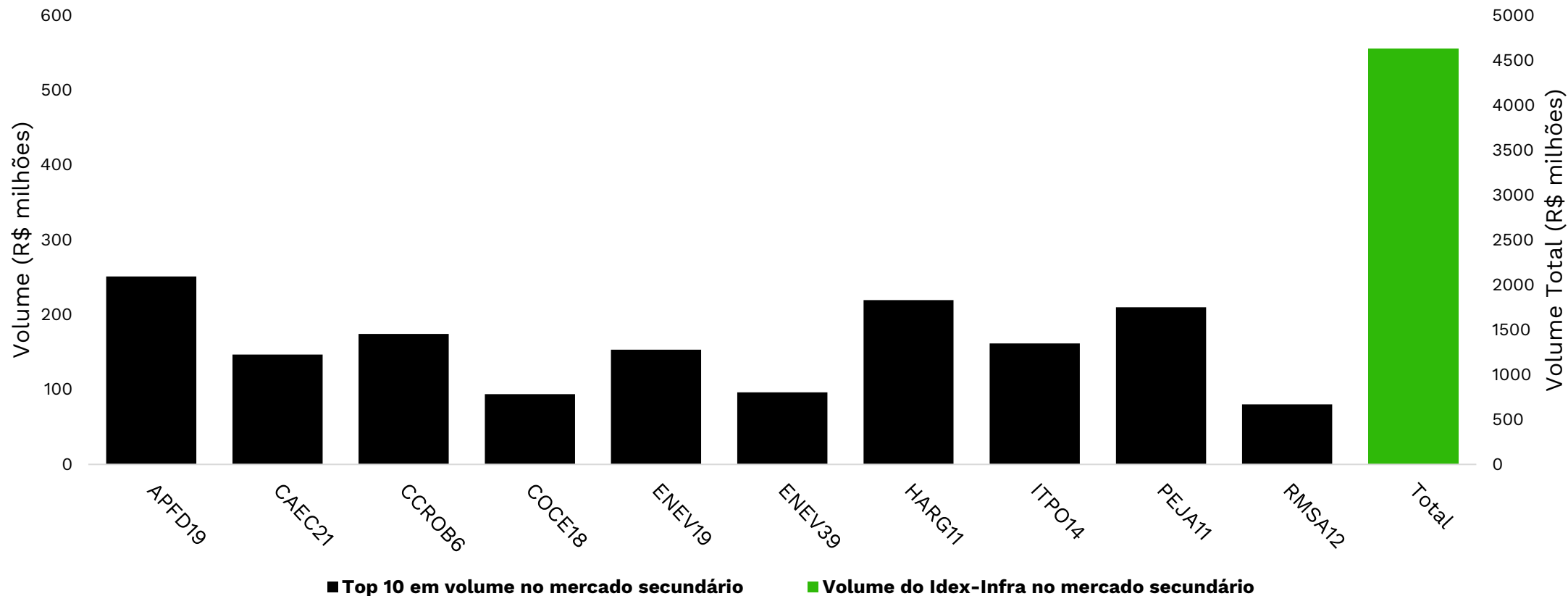
Exposição por Setor (30/06/23)



Histórico de Performance

Ano		Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Acum Ano
2023	Idex-Infra Geral	-0,19 %	-1,19 %	2,62 %	1,55 %	3,66 %	2,71 %							9,44 %
	Idex-Infra Core	-0,01 %	-1,71 %	2,84 %	1,84 %	3,43 %	2,75 %							9,39 %
2022	Idex-Infra Geral	-0,36 %	0,59 %	3,20 %	1,23 %	0,60 %	0,31 %	-1,05 %	0,72 %	-0,36 %	0,36 %	-1,03 %	0,99 %	5,26 %
	Idex-Infra Core	-0,30 %	0,40 %	3,09 %	1,20 %	0,63 %	0,27 %	-1,04 %	0,60 %	-0,48 %	0,35 %	-1,13 %	0,97 %	4,59 %
2021	Idex-Infra Geral	0,01 %	-0,47 %	-0,01 %	1,62 %	0,75 %	0,62 %	0,24 %	-0,32 %	0,59 %	-2,07 %	3,60 %	0,75 %	5,34 %
	Idex-Infra Core	-0,39 %	-0,51 %	-0,03 %	1,61 %	0,81 %	0,42 %	0,40 %	-0,32 %	0,52 %	-2,00 %	3,60 %	0,74 %	4,86 %

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



I dex-Infra 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
CTGE11	Eletrosul	7,36%
GSTS24	Aguas De Teresina	6,38%
SAPRA3	Sanepar	6,36%
ETSP12	Equatorial Transmissora 7 Spe	6,24%
HARG11	Holding Do Araguaia S.A.	6,08%
I dex-Infra Geral		2,72 %

5 Melhores variações de carregos no período

Ativo	Empresa	Carrego
ANET11	Americanet	0,97%
CPTM15	Ligga Telecomunicacoes	0,93%
VBRR11	Via Brasil	0,93%
ENAT11	Enauta Participacoes S.A.	0,89%
MTRJ19	Metrorio	0,89%
I dex-Infra Geral		0,70 %

5 Melhores variações a mercado no período

Ativo	Empresa	MTM
CTGE11	Eletrosul	6,63%
SAPRA3	Sanepar	5,66%
GSTS24	Aguas De Teresina	5,58%
ETSP12	Equatorial Transmissora 7 Spe	5,53%
HARG11	Holding Do Araguaia S.A.	5,30%
I dex-Infra Geral		2,01 %

5 Piores variações no período

Ativo	Empresa	Variação
ANET11	Americanet	-0,30%
CSNP12	Companhia Energética Sinop	-0,17%
CPTM15	Ligga Telecomunicacoes	-0,15%
PPTTE11	Porto Primavera	0,57%
CTEE15	Cteep	0,79%
I dex-Infra Geral		2,72 %

5 Piores variações de carregos no período

Ativo	Empresa	Carrego
PETR17	Petrobras	0,61%
PETR26	Petrobras	0,61%
PETR16	Petrobras	0,63%
PETR27	Petrobras	0,63%
ELET42	Eletrobras	0,64%
I dex-Infra Geral		0,70 %

5 Piores variações a mercado no período

Ativo	Empresa	MTM
ANET11	Americanet	-1,26%
CPTM15	Ligga Telecomunicacoes	-1,07%
CSNP12	Companhia Energética Sinop	-0,85%
PPTTE11	Porto Primavera	-0,07%
CTEE15	Cteep	0,01%
I dex-Infra Geral		2,01 %

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