

# Idex

Idex-Infra

**Agosto 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**

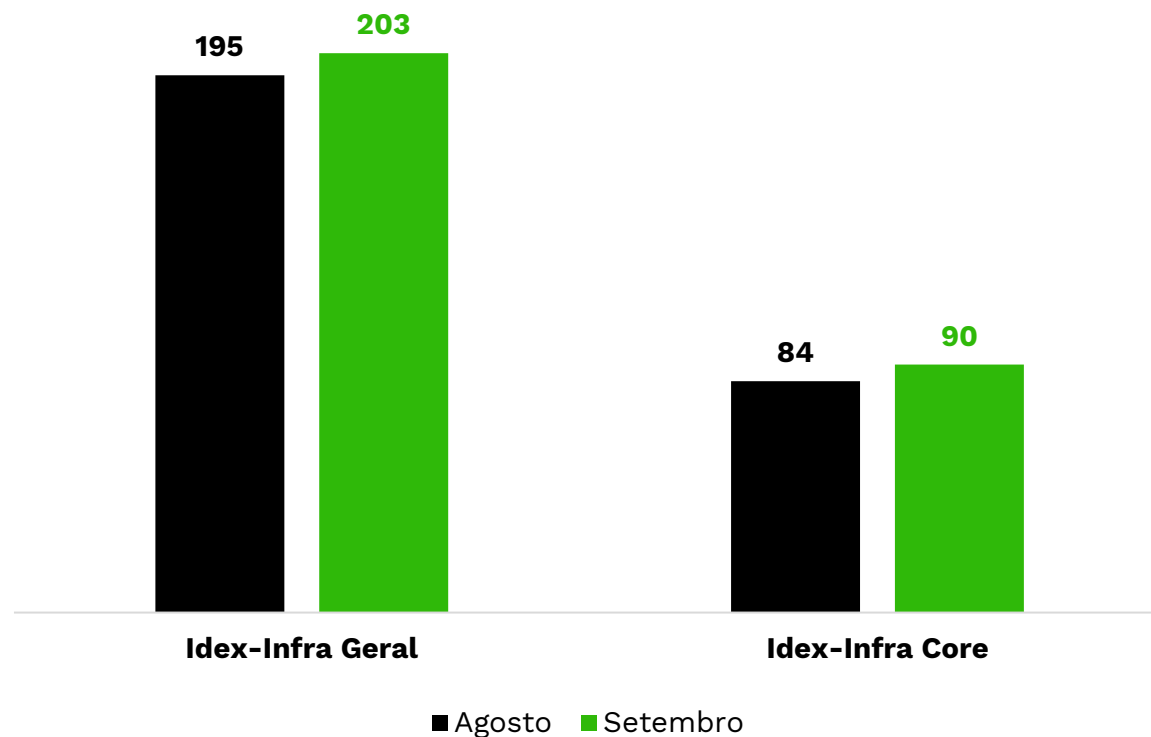
Idex-Infra JGP

---

# Comentário Mensal — Agosto

# Nova Amostra

## Alterações nas Amostras



## Alterações no Índice- Idex-Infra Geral (31-Ago — 01-Set)

Ingressaram no Idex-Infra (15)		Saíram do Idex-Infra (7)
AEAB11	RUMOA5	ARTR19
ANET12	SBSPC4	CEAL21
CMIN12	SUZB29	CSNP12
CONF11	TAAE17	ITPE12
CTEE29	VLIM13	PPTE11
IEMD12		TAEAA2
IRJS14		XNGU17
OMGE12		
PALF38		
PETR16		

# Destques de performance

## Idex-Infra Geral

### Maiores aberturas de spread (bps over B-ref)

Ativo	01-Ago	31-Ago	Dif
COCE27	-44,8	47,1	92
CPTM15	468,2	520,4	52
ANEM11	271,8	313,2	41
MNAU13	116,7	145,7	29
ENJG21	12,4	39,2	27

### Maiores fechamentos de spread (bps over B-ref)

Ativo	01-Ago	31-Ago	Dif
CMGD27	62,2	-2,4	-65
ESAM14	174,4	118,6	-56
ETEN31	89,3	35,5	-54
CART13	139,3	101,8	-38
IGSN15	242,1	205,9	-36

## Idex-Infra Core

### Maiores aberturas de spread (bps over B-ref)

Ativo	01-Ago	31-Ago	Dif
COCE27	-44,8	47,1	92
TAEEC2	39,9	60,5	21
PLSB1A	146,7	159,0	12
ODTR11	56,4	68,6	12
ENMTA4	61,3	70,9	10

### Maiores fechamentos de spread (bps over B-ref)

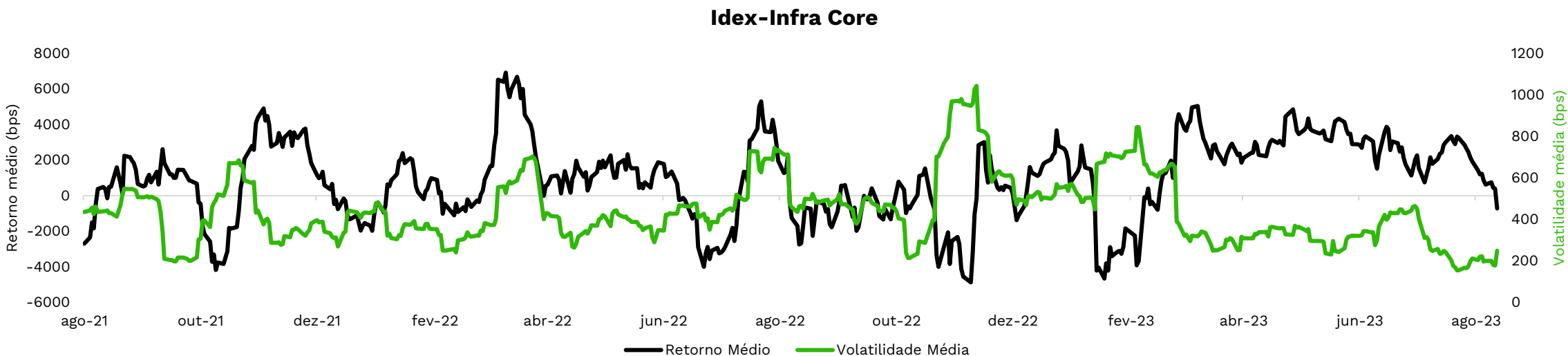
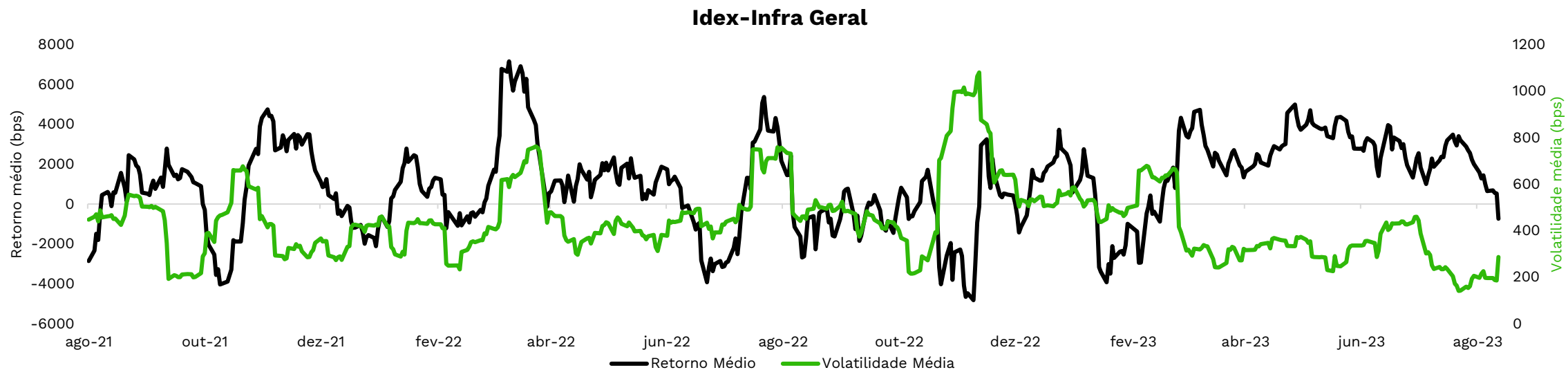
Ativo	01-Ago	31-Ago	Dif
CMGD27	62,2	-2,4	-65
CART13	139,3	101,8	-38
IGSN15	242,1	205,9	-36
PEJA11	182,6	147,9	-35
BRKP28	217,1	185,4	-32

**I dex- Infra JGP**

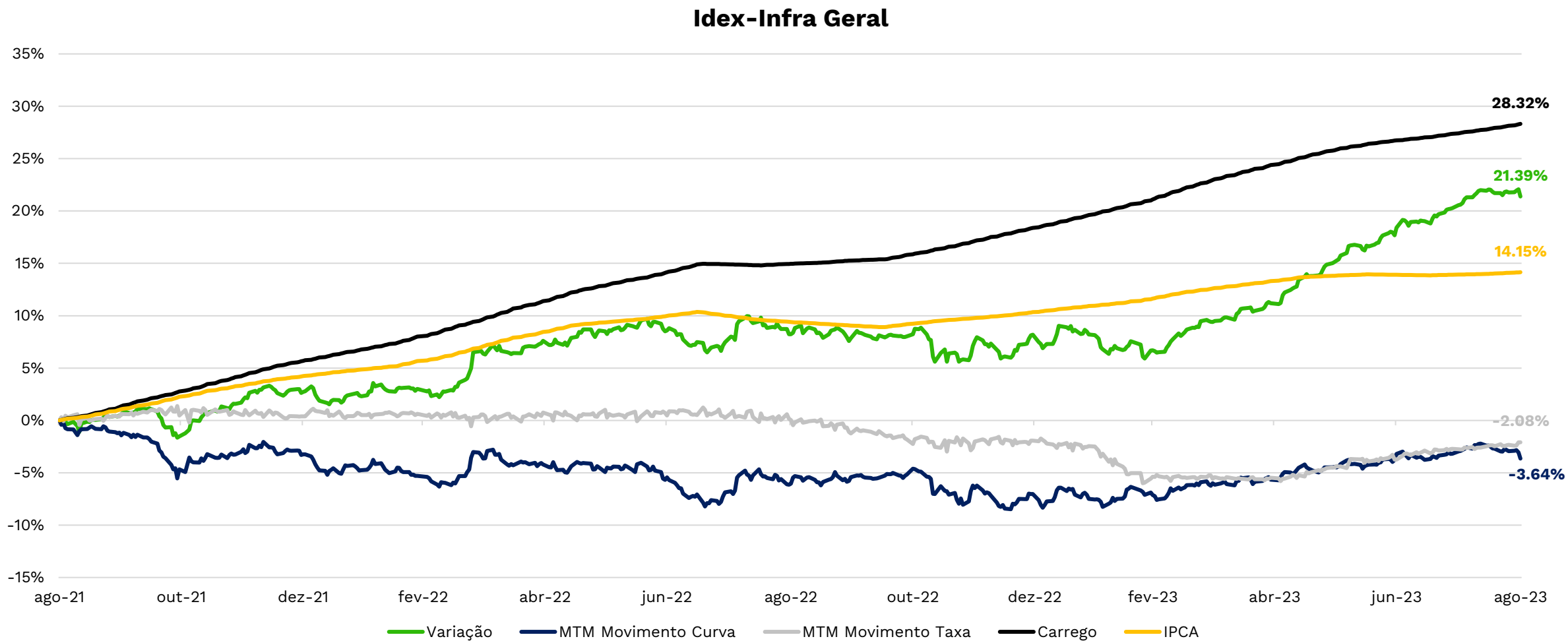
---

# **Gráficos e Tabelas**

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



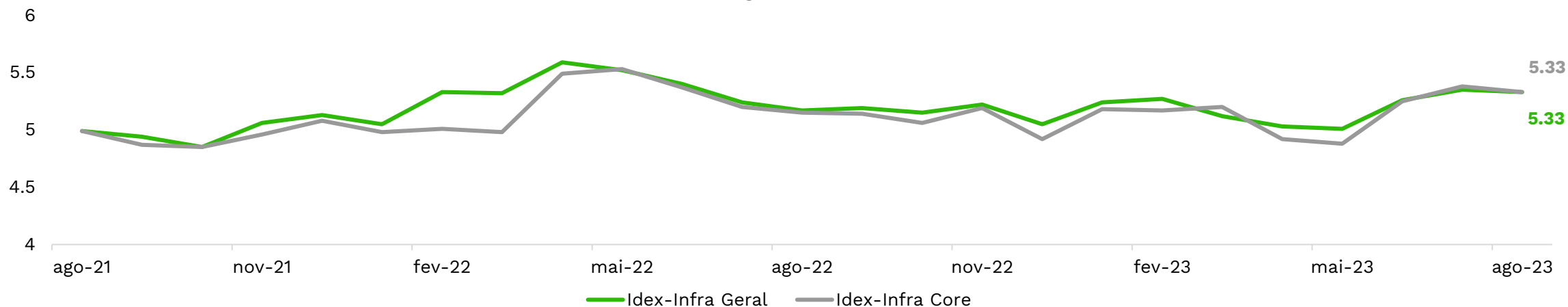
# Rentabilidade Acumulada (2 anos)



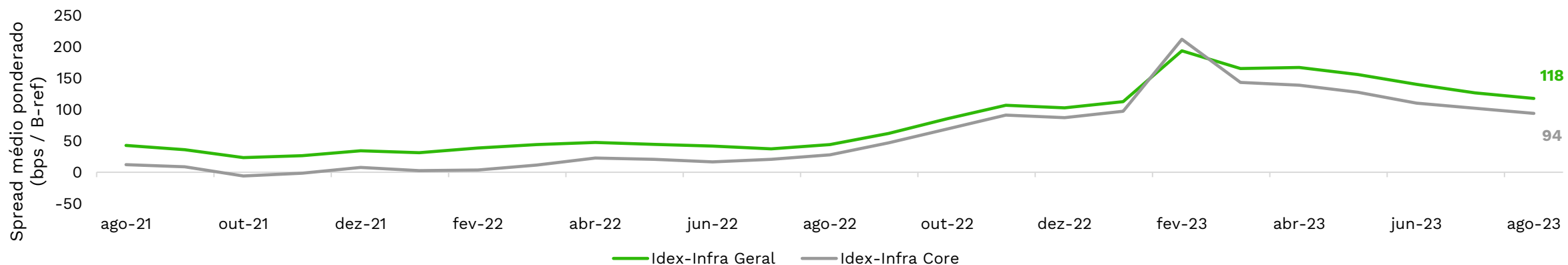
Fonte: JGP

# Duration e Spread

### Duration to Maturity Ponderada (em anos)



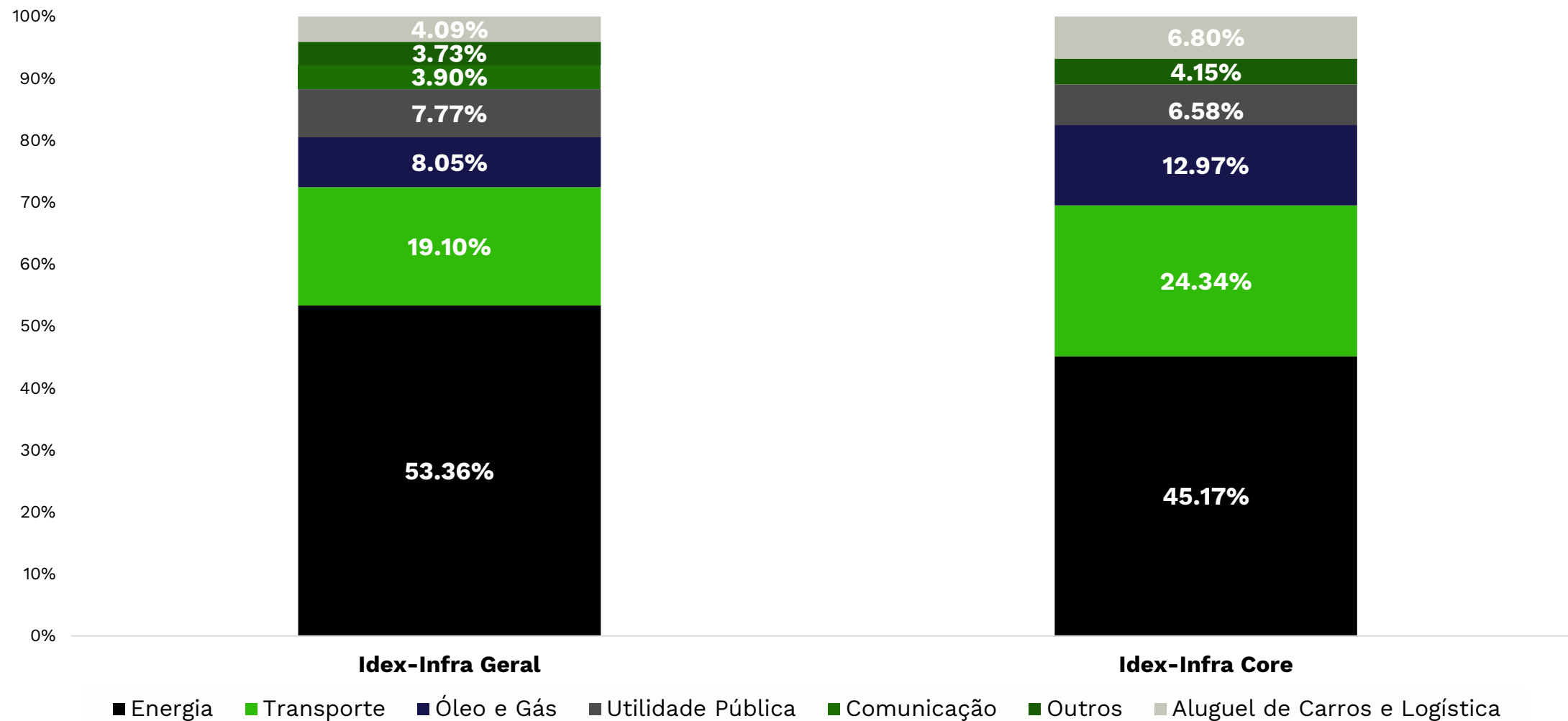
### Evolução mensal dos spreads médios: I dex - Infra Geral e I dex - Infra Core



Fonte: JGP



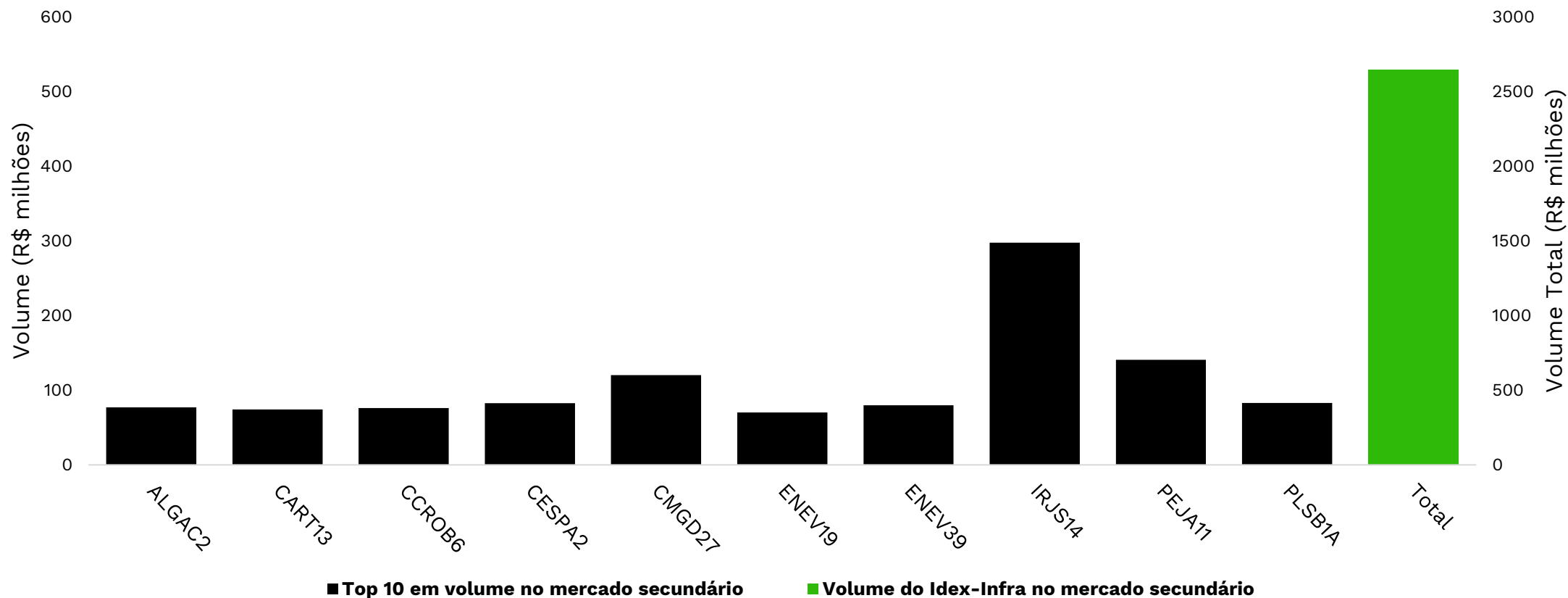
## Exposição por Setor (31/08/23)



# Histórico de Performance

Ano		Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Acum Ano
2023	<b>Idex-Infra Geral</b>	-0,19 %	-1,19 %	2,62 %	1,55 %	3,66 %	2,71 %	1,83 %	0,69 %					12,21 %
	<b>Idex-Infra Core</b>	-0,01 %	-1,71 %	2,84 %	1,84 %	3,43 %	2,75 %	1,70 %	0,65 %					11,97 %
2022	<b>Idex-Infra Geral</b>	-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 %
	<b>Idex-Infra Core</b>	-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	<b>Idex-Infra Geral</b>	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 %
	<b>Idex-Infra Core</b>	-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 (01/08/23 — 31/08/23) 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
ESAM14	Empresa De Energia São Manoel	2,74%
CPGT27	Copel Geracao E Transmissao	2,63%
UNEG11	Ute Gna	2,59%
CEAL21	Equatorial Alagoas Distribuidora De Energia S.A.	2,15%
CPLD26	Copel Distribuicao	2,09%
<b>Idex-Infra Geral</b>		<b>0,69 %</b>

## 5 Melhores variações de carregos no período

Ativo	Empresa	Carrego
CPTM15	Ligga Telecomunicacoes	1,02%
VBRR11	Via Brasil	0,99%
ENAT11	Enauta Participacoes S.A.	0,97%
ANET11	Americanet	0,97%
NTEN11	Norte Energia	0,97%
<b>Idex-Infra Geral</b>		<b>0,71 %</b>

## 5 Melhores variações a mercado no período

Ativo	Empresa	MTM
ESAM14	Empresa De Energia São Manoel	1,98%
CPGT27	Copel Geracao E Transmissao	1,94%
UNEG11	Ute Gna	1,81%
CEAL21	Equatorial Alagoas Distribuidora De Energia S.A.	1,45%
CPLD26	Copel Distribuicao	1,42%
<b>Idex-Infra Geral</b>		<b>-0,02 %</b>

## 5 Piores variações no período

Ativo	Empresa	Variação
ANEM11	Anemus Wind Holding S.A.	-2,10%
CPTM15	Ligga Telecomunicacoes	-1,67%
TAEEC2	Taesa	-1,51%
MSGT33	Mata De Santa Genebra	-1,17%
PETR27	Petrobras	-1,11%
<b>Idex-Infra Geral</b>		<b>0,69 %</b>

## 5 Piores variações de carregos no período

Ativo	Empresa	Carrego
PETR17	Petrobras	0,63%
PETR26	Petrobras	0,64%
SBSPE9	Sabesp	0,64%
PPTE11	Porto Primavera	0,64%
FGEN13	Ferreira Gomes Energia	0,65%
<b>Idex-Infra Geral</b>		<b>0,71 %</b>

## 5 Piores variações a mercado no período

Ativo	Empresa	MTM
ANEM11	Anemus Wind Holding S.A.	-2,93%
CPTM15	Ligga Telecomunicacoes	-2,66%
TAEEC2	Taesa	-2,14%
MSGT33	Mata De Santa Genebra	-1,88%
PETR27	Petrobras	-1,76%
<b>Idex-Infra Geral</b>		<b>-0,02 %</b>

# 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](http://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