

Idex

Idex-Infra

Setembro 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,

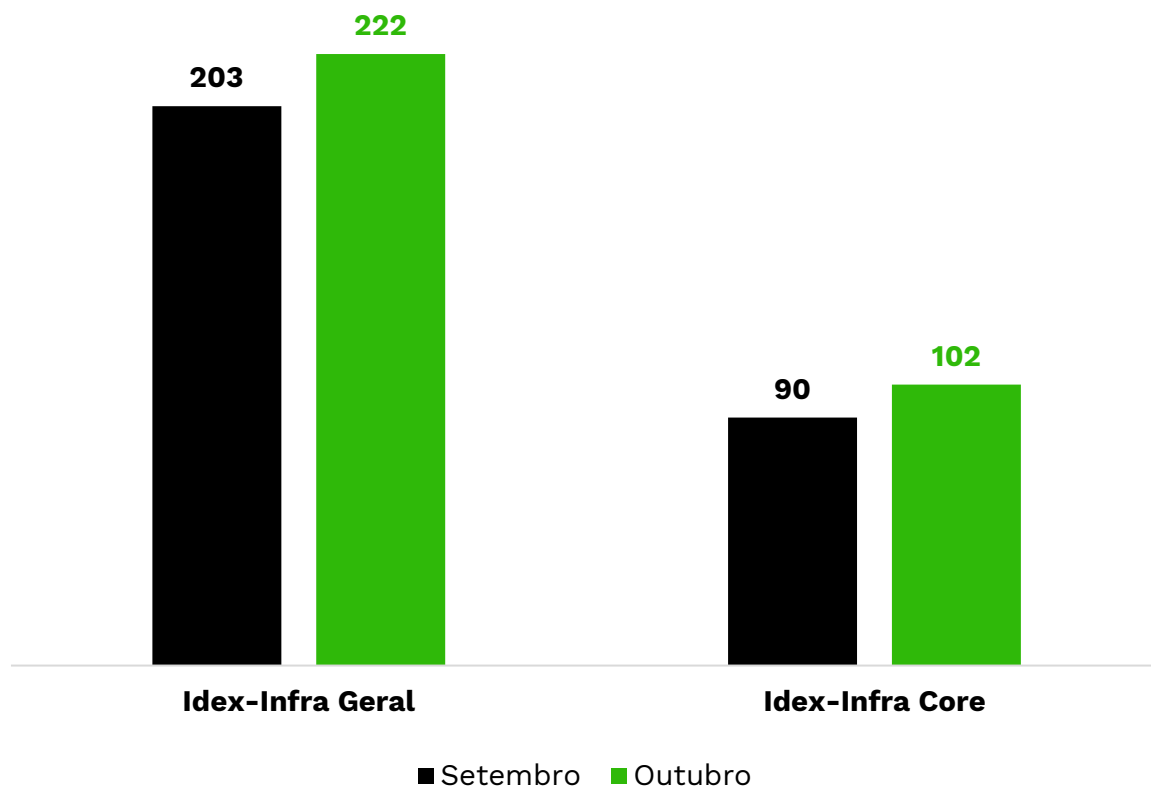
JGP

Idex-Infra JGP

Comentário Mensal — Setembro

Nova Amostra

Alterações nas Amostras



Alterações no Índice- Idex-Infra Geral (29-Set — 02-Out)

Ingressaram no Idex-Infra (19)

AESL17	GASC22
ALGA26	MRSL19
ARTR35	PETR25
CART12	SBSPD4
CPGT26	SRTI11
CPGT28	TBLE26
CSNAB4	VERO12
CTEE15	
CTEE17	
EGIE17	
EGIE19	
ELPLB4	

Destques de performance

Idex-Infra Geral

Maiores aberturas de spread (bps over B-ref)

Ativo	01-Set	29-Set	Dif
PRTE12	21,8	67,1	45
PRAS11	124,4	165,9	41
CONF11	135,5	172,9	37
ENMI21	15,2	51,5	36
ENJG21	15,2	46,3	31

Maiores fechamentos de spread (bps over B-ref)

Ativo	01-Set	29-Set	Dif
ENAT11	417,5	287,4	-130
VBRR11	430,3	350,9	-79
ANET12	441,7	374,9	-67
MTRJ19	330,1	273,7	-56
NTEN11	404,7	350,1	-55

Idex-Infra Core

Maiores aberturas de spread (bps over B-ref)

Ativo	01-Set	29-Set	Dif
ODTR11	56,4	87,5	31
TAEEC2	66	95,1	29
CART13	114,4	140,3	26
PLSB1A	166,3	191,7	25
CMGD27	15,7	39,7	24

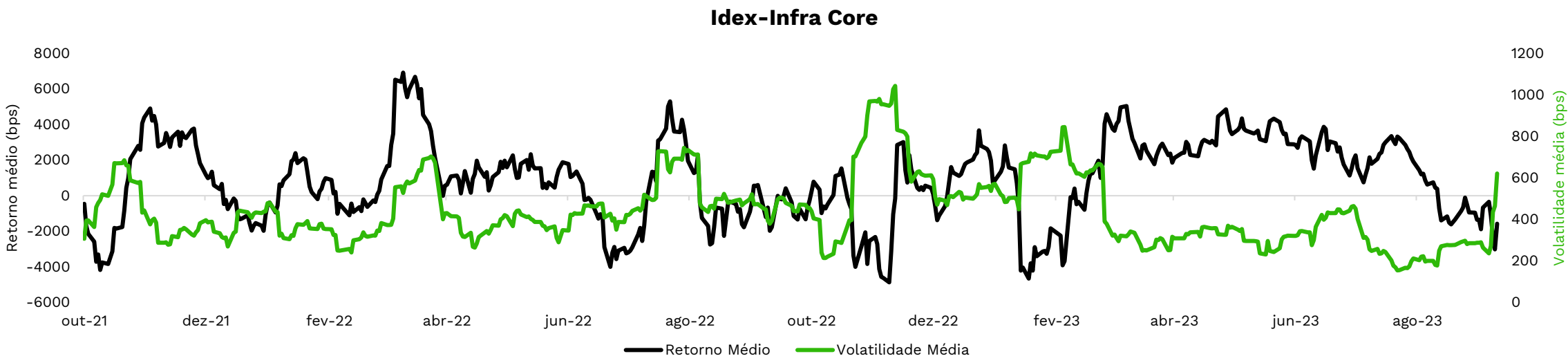
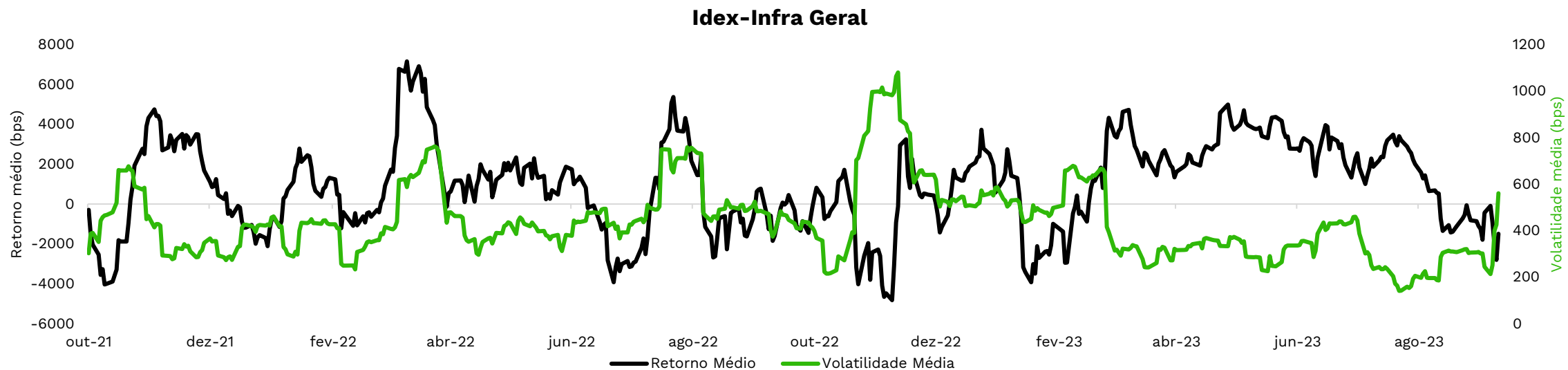
Maiores fechamentos de spread (bps over B-ref)

Ativo	01-Set	29-Set	Dif
MTRJ19	330,1	273,7	-56
CRMG15	173,4	147,3	-26
IGSN15	209,4	191,5	-18
ENGIA1	64,3	52,4	-12
TIET29	111,2	101,3	-10

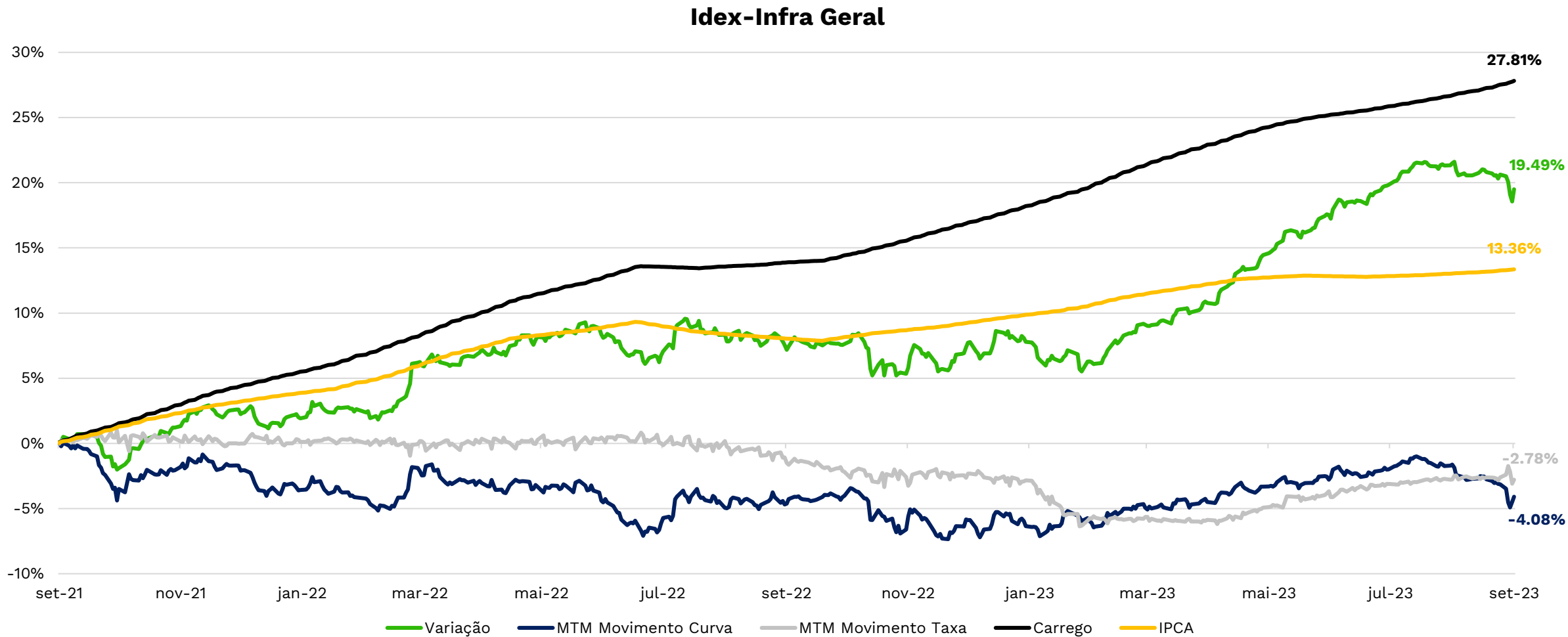
Idex- Infra JGP

Gráficos e Tabelas

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



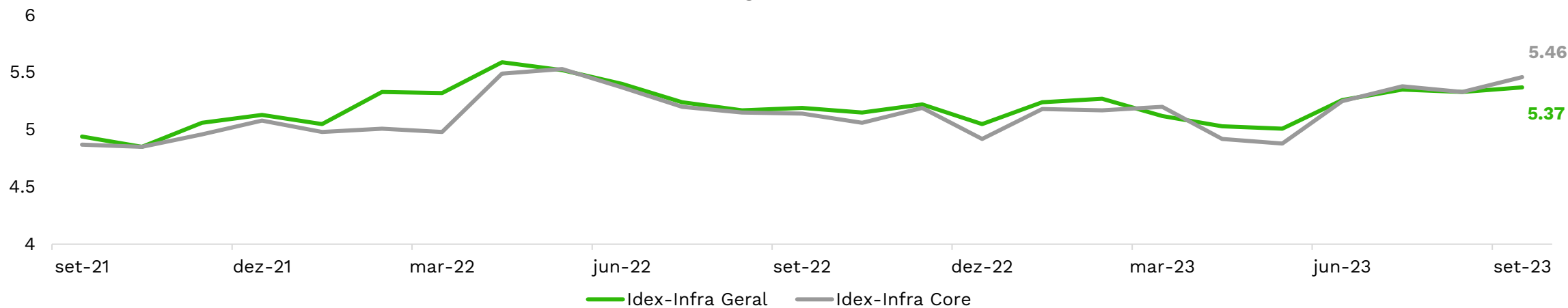
Rentabilidade Acumulada (2 anos)



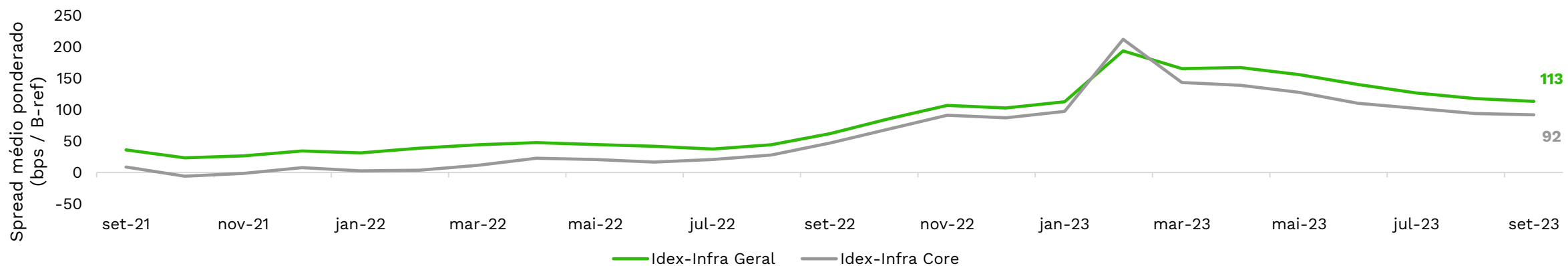
Fonte: JGP

Duration e Spread

Duration to Maturity Ponderada (em anos)

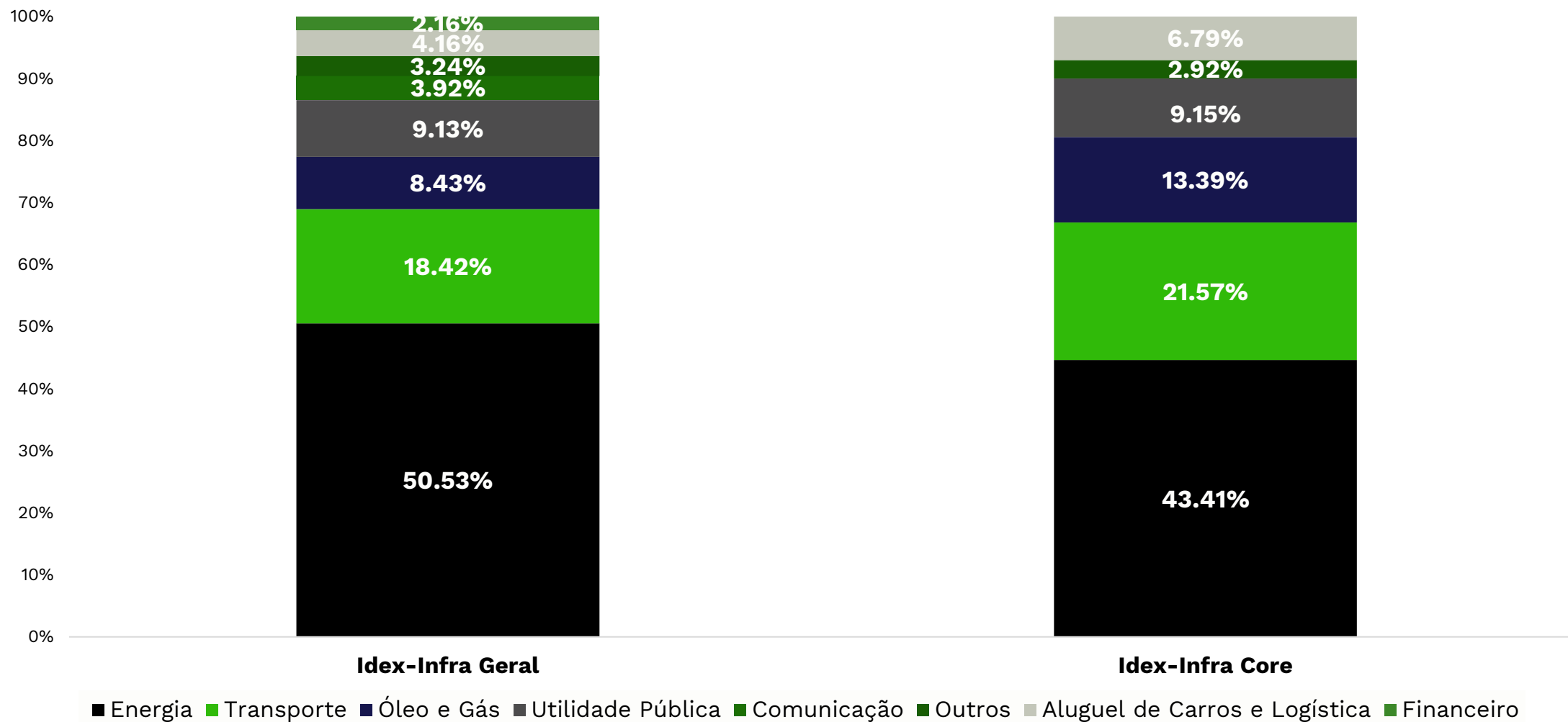


Evolução mensal dos spreads médios: Idex - Infra Geral e Idex - Infra Core



Fonte: JGP

Exposição por Setor (29/09/23)

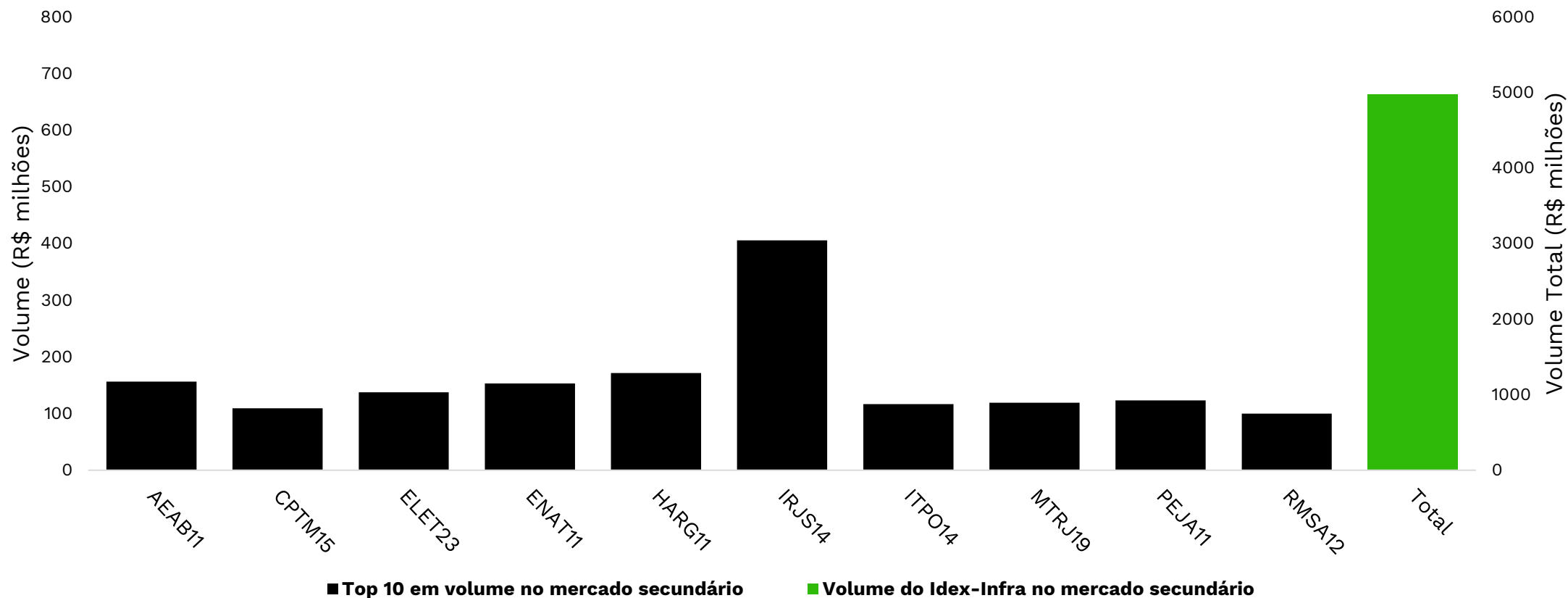


Fonte: JGP

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 %	1,83 %	0,69 %	-1,19 %				10,87 %
	Idex-Infra Core	-0,01 %	-1,71 %	2,84 %	1,84 %	3,43 %	2,75 %	1,70 %	0,65 %	-1,37 %				10,43 %
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 (01/09/23 — 29/09/23) em R\$ milhões



Idex-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
ENAT11	Enauta Participacoes S.A.	4,00%
ANET12	Americanet	2,56%
VBRR11	Via Brasil	2,07%
MTRJ19	Metrório	1,74%
NTEN11	Norte Energia	1,40%
Idex-Infra Geral		-1,19 %

5 Melhores variações de carregos no período

Ativo	Empresa	Carrego
CPTM15	Ligga Telecomunicacoes	1,12%
VBRR11	Via Brasil	1,02%
ANET11	Americanet	1,01%
ENAT11	Enauta Participacoes S.A.	1,01%
NTEN11	Norte Energia	1,00%
Idex-Infra Geral		0,80 %

5 Melhores variações a mercado no período

Ativo	Empresa	MTM
ENAT11	Enauta Participacoes S.A.	2,96%
ANET12	Americanet	1,55%
VBRR11	Via Brasil	1,04%
MTRJ19	Metrório	0,79%
NTEN11	Norte Energia	0,40%
Idex-Infra Geral		-1,97 %

5 Piores variações no período

Ativo	Empresa	Variação
CONF11	Confluencia Energia S/A	-3,97%
EGIEA0	Engie Brasil	-3,33%
TAEEC2	Taesa	-3,28%
CART13	Concessionaria Auto Raposo Tavares	-3,23%
PRAS11	Pirapora Solar Holding	-3,12%
Idex-Infra Geral		-1,19 %

5 Piores variações de carregos no período

Ativo	Empresa	Carrego
SBSPC4	Sabesp	0,72%
PETR16	Petrobras	0,72%
PETR26	Petrobras	0,73%
PETR17	Petrobras	0,73%
EXTZ11	Sao Francisco	0,74%
Idex-Infra Geral		0,80 %

5 Piores variações a mercado no período

Ativo	Empresa	MTM
CONF11	Confluencia Energia S/A	-4,78%
EGIEA0	Engie Brasil	-4,07%
TAEEC2	Taesa	-4,01%
CART13	Concessionaria Auto Raposo Tavares	-4,00%
PRAS11	Pirapora Solar Holding	-3,91%
Idex-Infra Geral		-1,97 %

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