

Idex

Idex-CDI

Outubro 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,

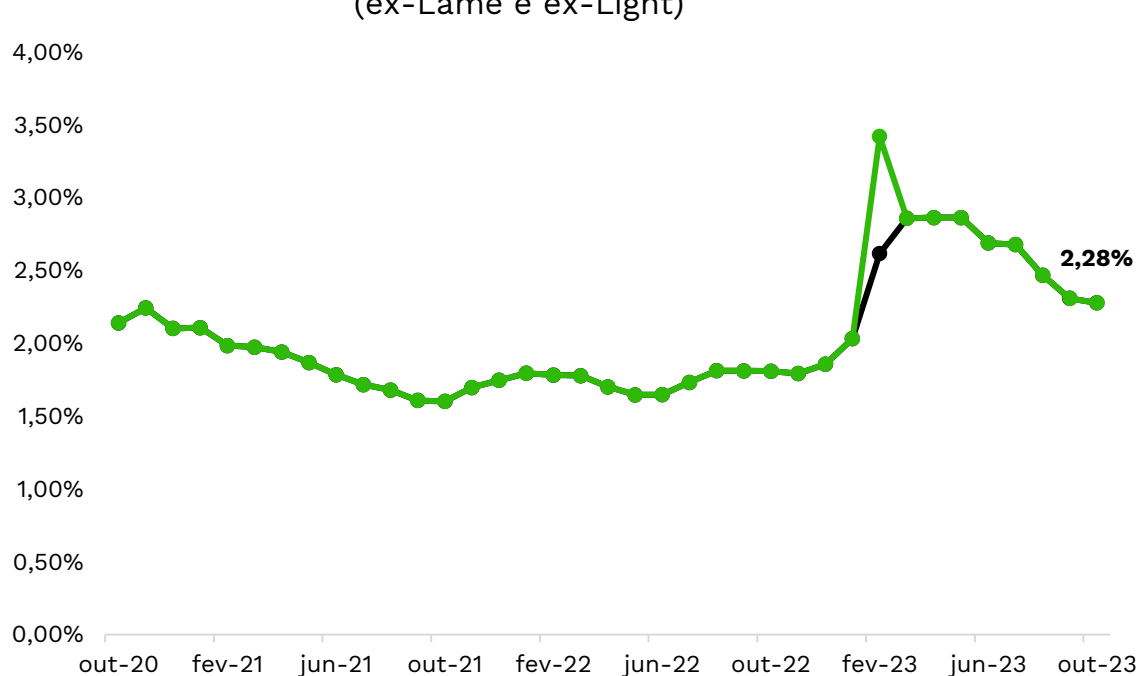
JGP

Idex-CDI JGP

Comentário Mensal — Outubro

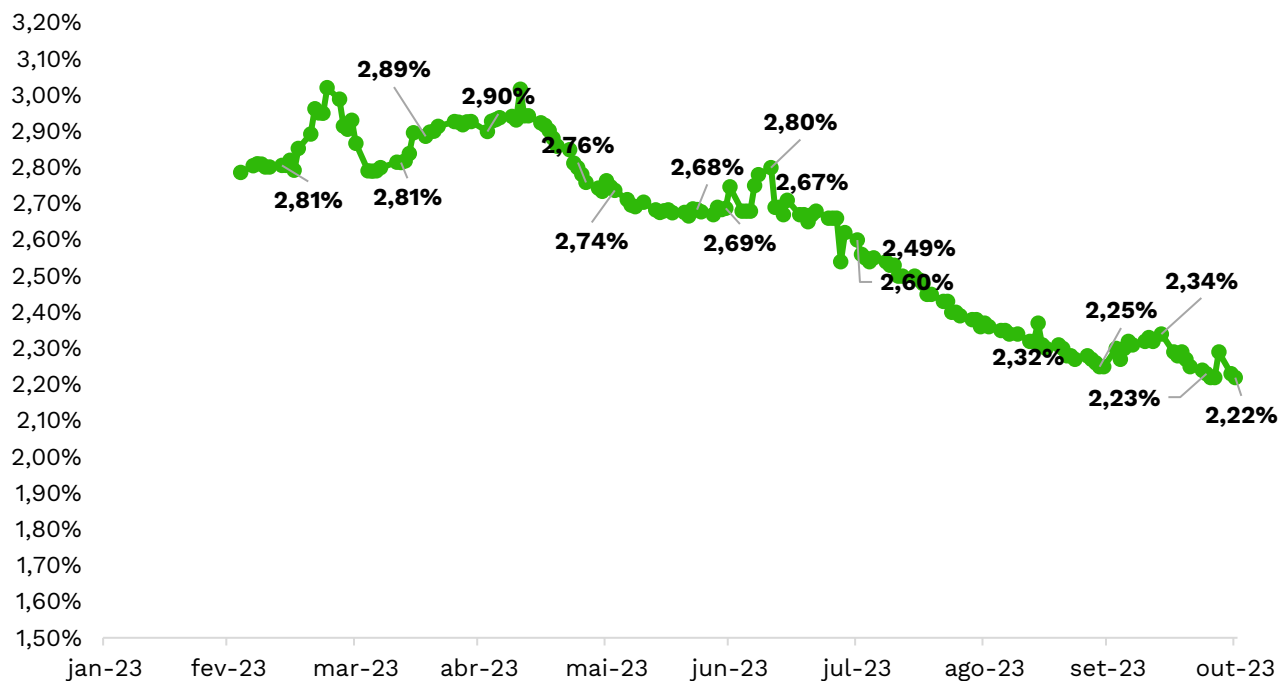
Comentário Mensal

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

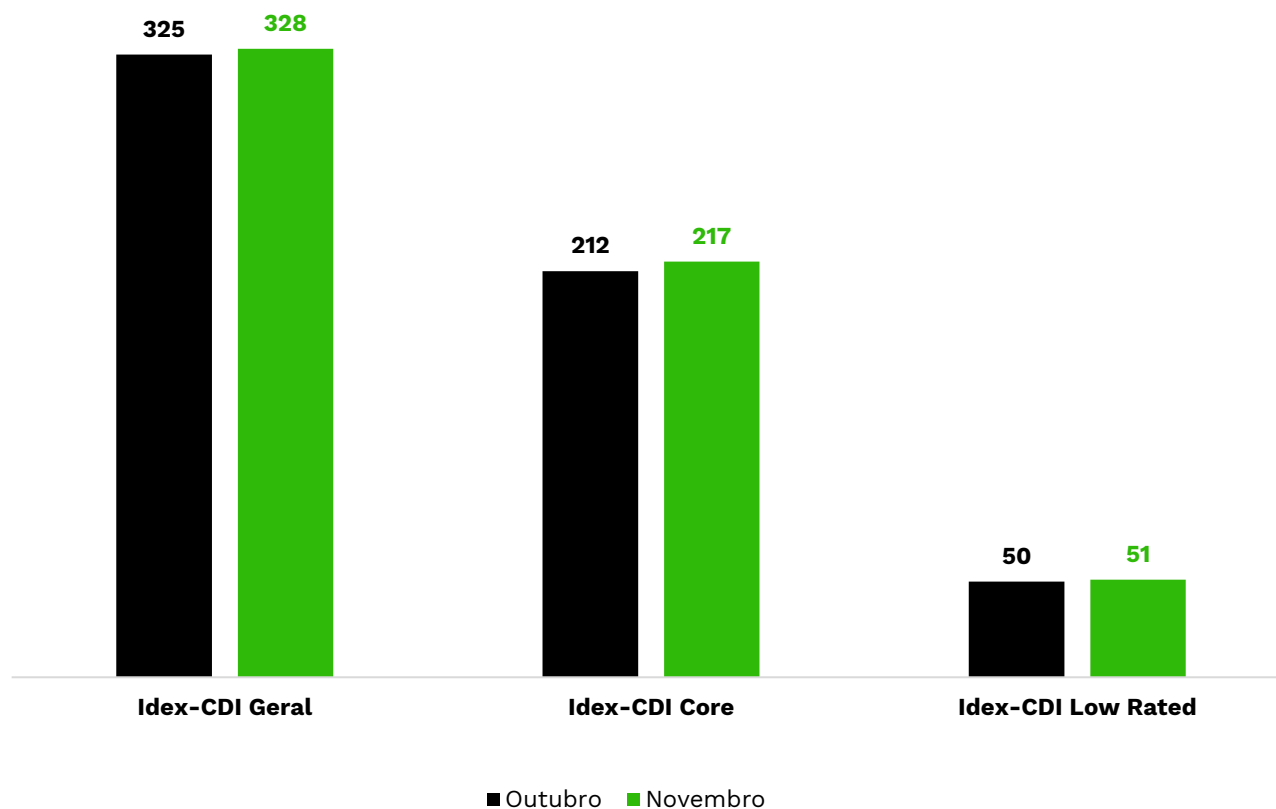
Evolução do *spread* diário do Idex-CDI (ex-Lame e Light)



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

Nova Amostra

Alterações na Amostra



Alterações no Índice - Idex-CDI Geral (31-Out — 01-Nov)

Ingressaram no Idex-CDI (11)

ALGA19

BBML13

CEAB12

CEEBA6

CPLD28

CPLD38

ERDVA2

HBSA12

RDORD9

RENTA5

VBRR24

Saíram do Idex- CDI (8)

ALGA18

ENGA7

LCAMD2

NCFP14

NIGP12

RDCO20

RSAN24

SULM16

Destques de performance

Maiores aberturas de spread %DI

Ativo	02-Out	31-Out	Dif
CPGT16	108,50%	109,00%	0,50%
EBENA0	108,50%	109,00%	0,50%
HAPV21	122,50%	123,00%	0,50%

Maiores fechamentos de spread %DI

Ativo	02-Out	31-Out	Dif
CEEBB2	118,00%	116,00%	-2,00%
RADL14	112,00%	111,00%	-1,00%
PETR36	111,00%	110,00%	-1,00%

Maiores aberturas de spread DI+

Ativo	02-Out	31-Out	Dif
MGLUA0	9,00%	11,00%	2,00%
ELFA12	9,00%	10,90%	1,90%
AGAU12	4,20%	5,00%	0,80%

Maiores fechamentos de spread DI+

Ativo	02-Out	31-Out	Dif
KLAS12	5,00%	3,70%	-1,30%
HGLB12	4,45%	3,60%	-0,85%
CEAB11	4,65%	3,90%	-0,75%

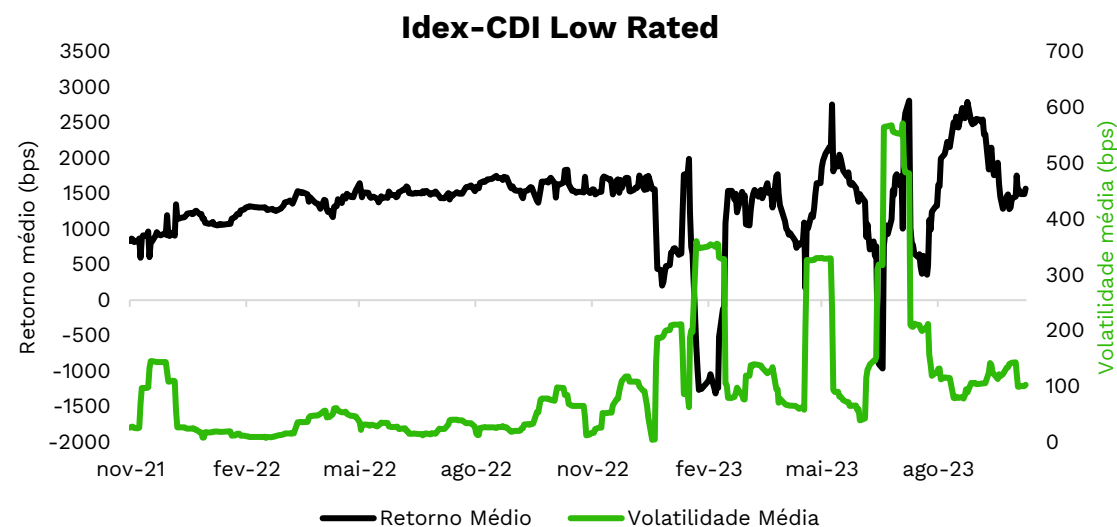
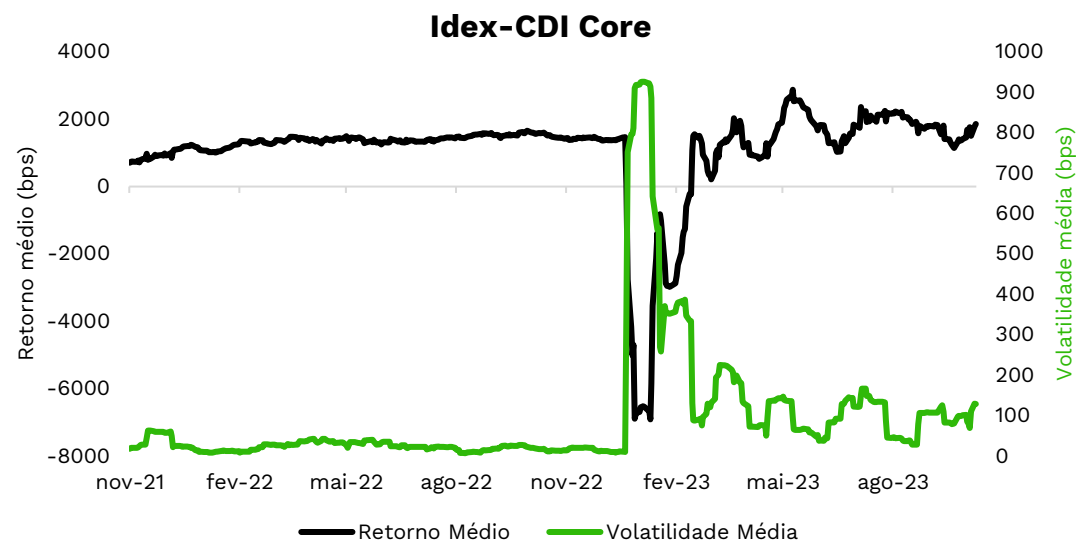
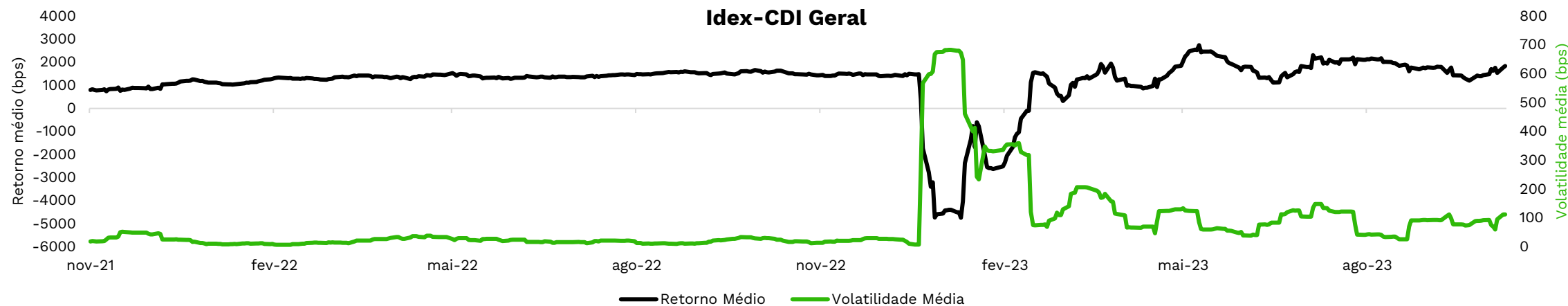
Rentabilidade do Idex-CDI Geral (12 meses)

Mês	%DI	DI+	CDI
2023/10	1,26%	1,28%	1,00%
2023/09	1,26%	1,45%	0,97%
2023/08	1,54%	1,93%	1,14%
2023/07	1,25%	1,66%	1,07%
2023/06	1,39%	1,25%	1,07%
2023/05	1,45%	1,81%	1,12%
2023/04	0,90%	0,77%	0,92%
2023/03	1,19%	1,15%	1,17%
2023/02	-0,06%	-1,22%	0,92%
2023/01	0,89%	0,67%	1,12%
2022/12	1,27%	1,28%	1,12%
2022/11	1,10%	1,10%	0,97%
Total	14,28%	13,91%	13,36%

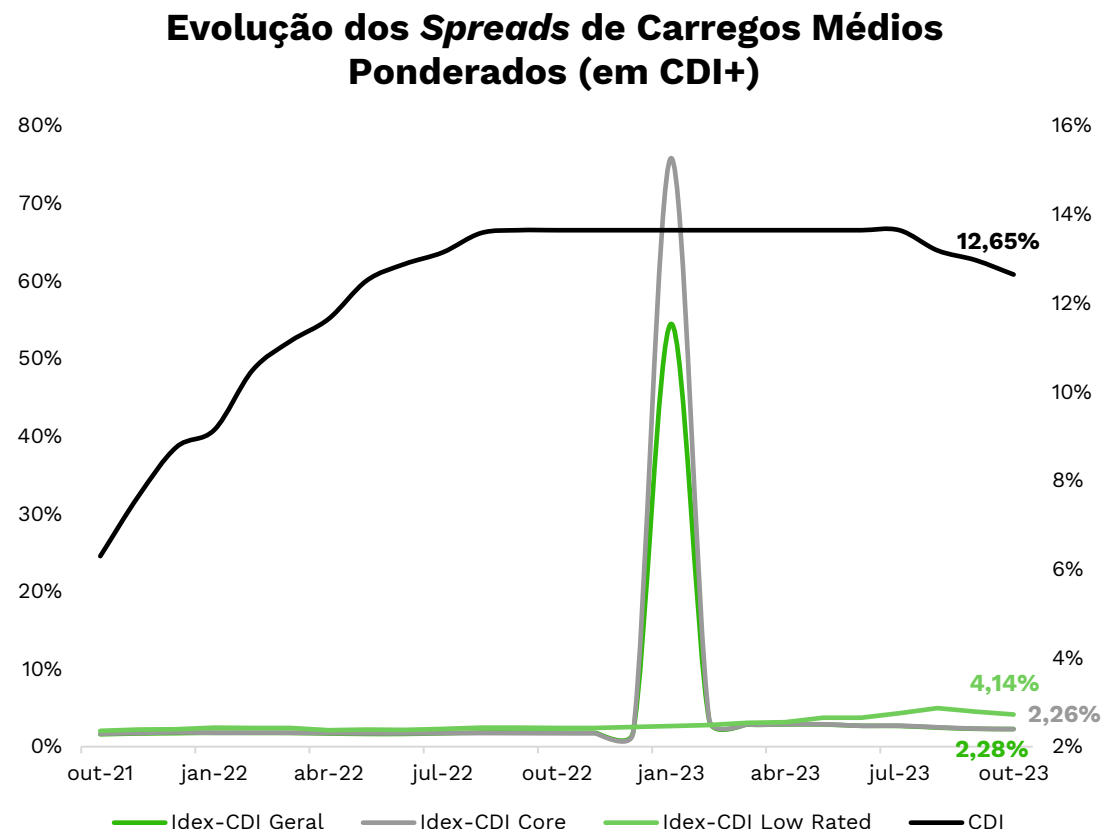
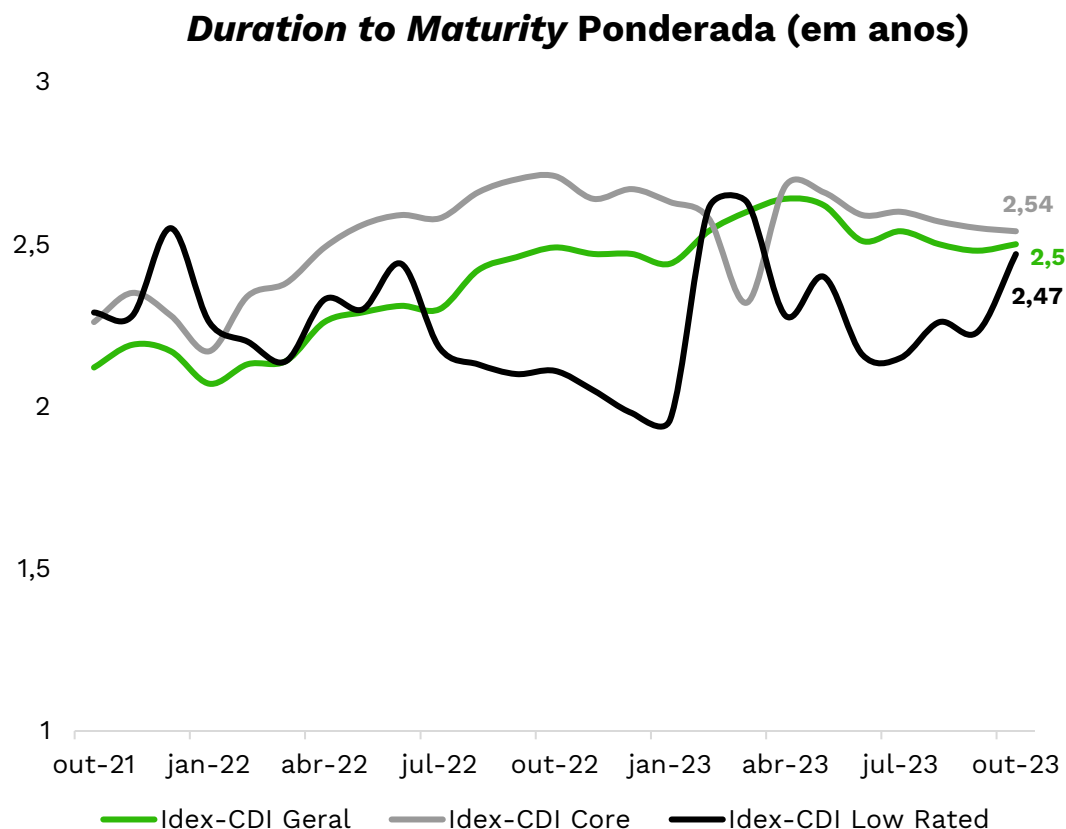
Idex-CDI JGP

Gráficos e Tabelas

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



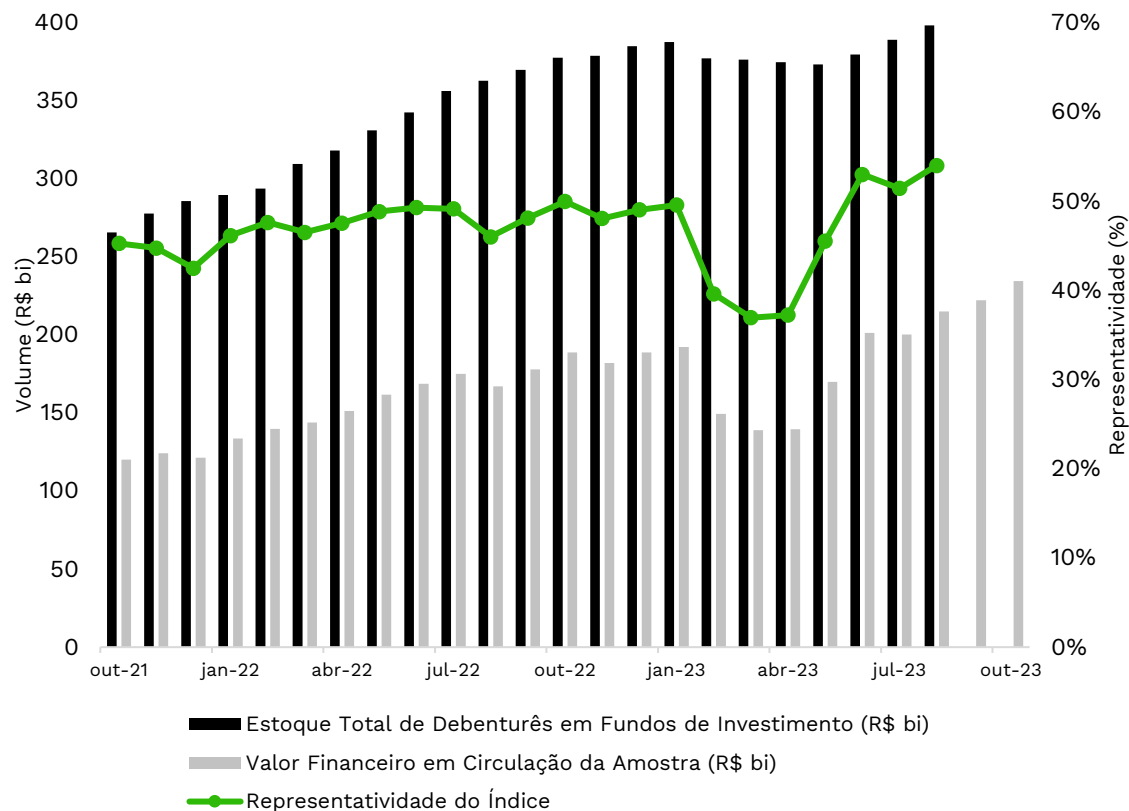
Duration e Spread



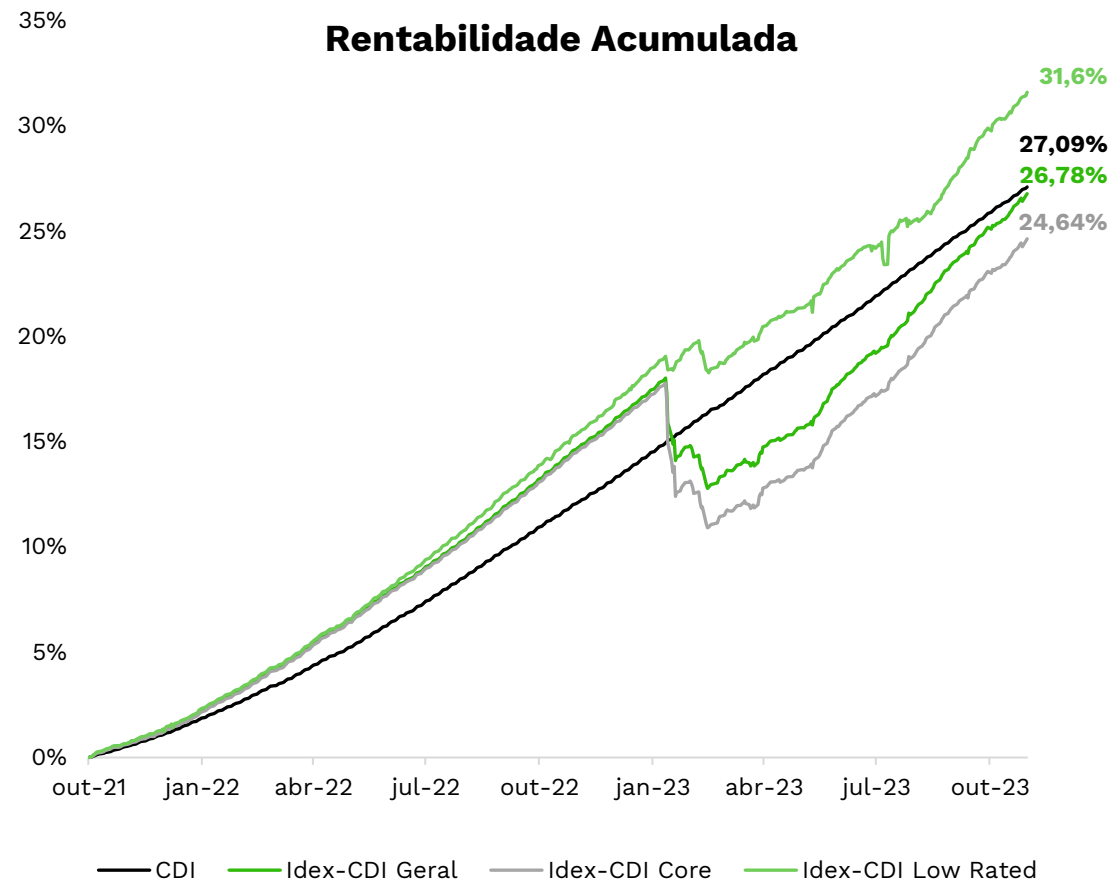
Fonte: JGP

Idex-CDI Geral

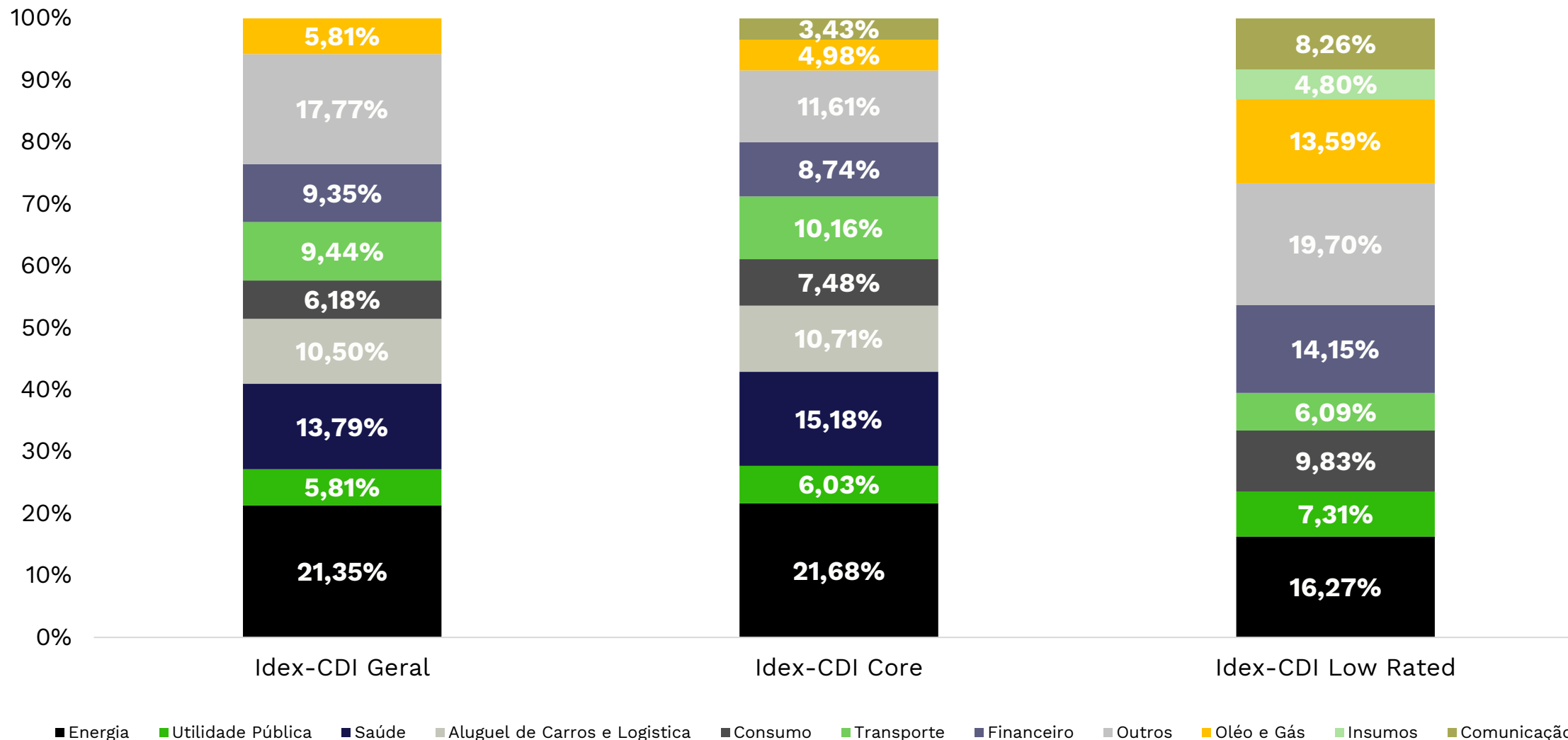
Representatividade do Índice



Rentabilidade Acumulada



Exposição por Setor (31/10/23)



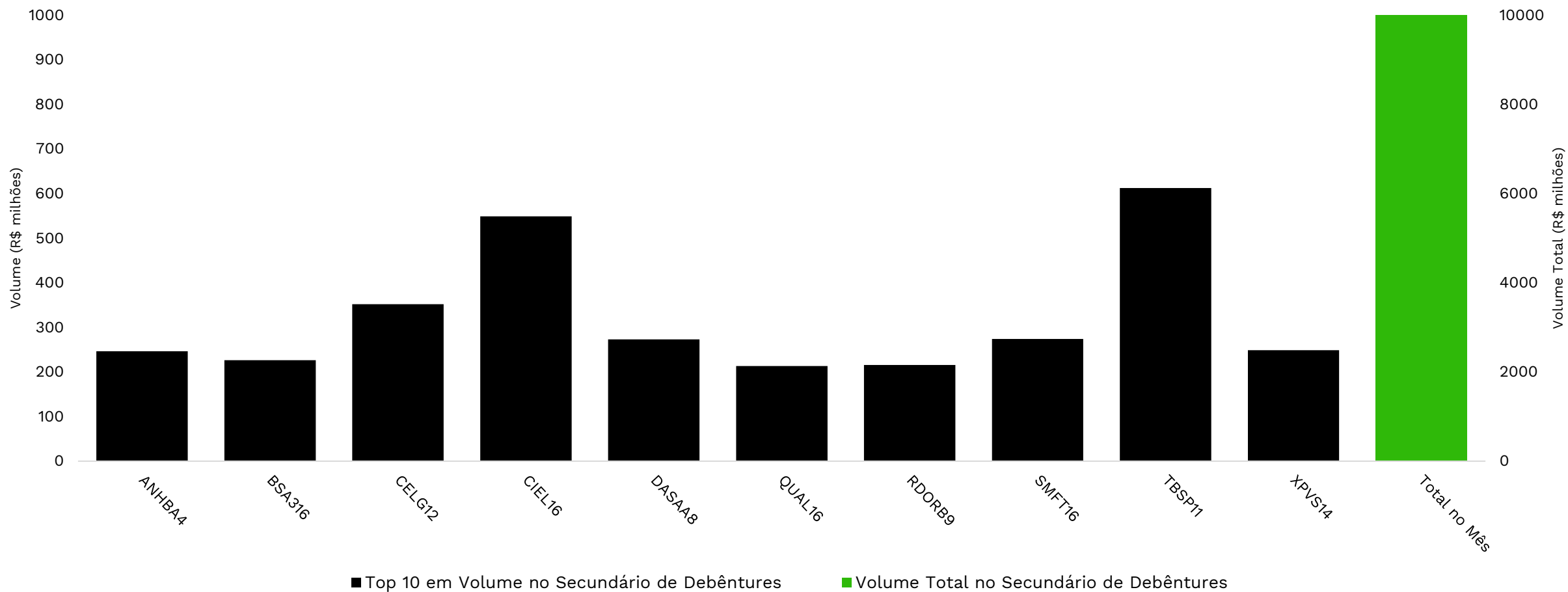
Fonte: JGP

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 %	1,64 %	1,89 %	1,41 %	1,28 %			7,95 %
	Idex-CDI Core	-3,49 %	-1,41 %	1,13 %	0,75 %	1,83 %	1,25 %	1,63 %	1,92 %	1,43 %	1,26 %			6,33 %
	Idex-CDI Low Rated	0,83 %	-0,61 %	1,47 %	0,73 %	1,48 %	0,84 %	1,06	1,58 %	1,89 %	1,31 %			11,08 %
	CDI	1,12 %	0,92 %	1,17 %	0,92 %	1,12 %	1,07 %	1,07 %	1,14 %	0,97 %	1,00 %			11,02 %
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 %

Fonte: JGP

Volume no Secundário das Debêntures da Amostra (02/10/23 a 31/10/23) em R\$ milhões



Fonte: JGP

Iindex-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
KLAS12	Kallas Incorporacoes E Construcoes	3,42%	342,44%
BKBR19	Bk Brasil	3,08%	308,77%
TEND19	Tenda	2,92%	292,90%
ONCO29	Oncoclinicas Do Brasil Servicos Medicos S.A.	2,59%	259,72%
CBRDA8	Cbd	2,58%	258,53%
Iindex-CDI Geral		1,28%	128,48%

5 Melhores variações de carregos no período

Ativo	Empresa	Carrego	% DI
AERI12	Aeris	2,44%	244,16%
AERI11	Aeris	2,40%	240,75%
CBRDA8	Cbd	2,39%	239,87%
ELFA12	Elfa Medicamentos	1,77%	177,00%
MGLUA0	Magazine Luiza S.A.	1,73%	173,63%
Iindex-CDI Geral		1,19%	118,98%

5 Melhores variações a mercado no período

Ativo	Empresa	MTM	% DI
KLAS12	Kallas Incorporacoes E Construcoes	2,06%	206,62%
BKBR19	Bk Brasil	1,74%	173,98%
TEND19	Tenda	1,50%	150,07%
ONCO29	Oncoclinicas Do Brasil Servicos Medicos S.A.	1,35%	135,61%
UNIP17	Unipar	1,26%	126,70%
Iindex-CDI Geral		0,09%	9,39%

5 Piores variações no período

Ativo	Empresa	Variação	% DI
MGLUA0	Magazine Luiza S.A.	-5,02%	-503,10%
ELFA12	Elfa Medicamentos	-2,11%	-211,69%
KRSA11	Kora Saude Participacoes S.A.	-0,83%	-83,69%
HSPA12	Hospital Anchieta S.A.	0,29%	29,25%
QUAL16	Qualicorp	0,43%	43,38%
Iindex-CDI Geral		1,28%	128,48%

5 Piores variações de carregos no período

Ativo	Empresa	Carrego	% DI
BSA315	B3	1,06%	106,67%
SBSPB3	Sabesp	1,07%	106,90%
ALGA18	Algar Telecom	1,07%	107,14%
NCFP14	Ncf Participações	1,07%	107,76%
SNGO16	Saneago	1,08%	107,80%
Iindex-CDI Geral		1,19%	118,98%

5 Piores variações a mercado no período

Ativo	Empresa	MTM	% DI
MGLUA0	Magazine Luiza S.A.	-6,64%	-665,80%
ELFA12	Elfa Medicamentos	-3,81%	-382,27%
KRSA11	Kora Saude Participacoes S.A.	-2,40%	-240,43%
HSPA12	Hospital Anchieta S.A.	-1,35%	-134,85%
QUAL16	Qualicorp	-0,90%	-90,24%
Iindex-CDI Geral		0,09%	9,39%

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