

Idex

Idex-Infra

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,

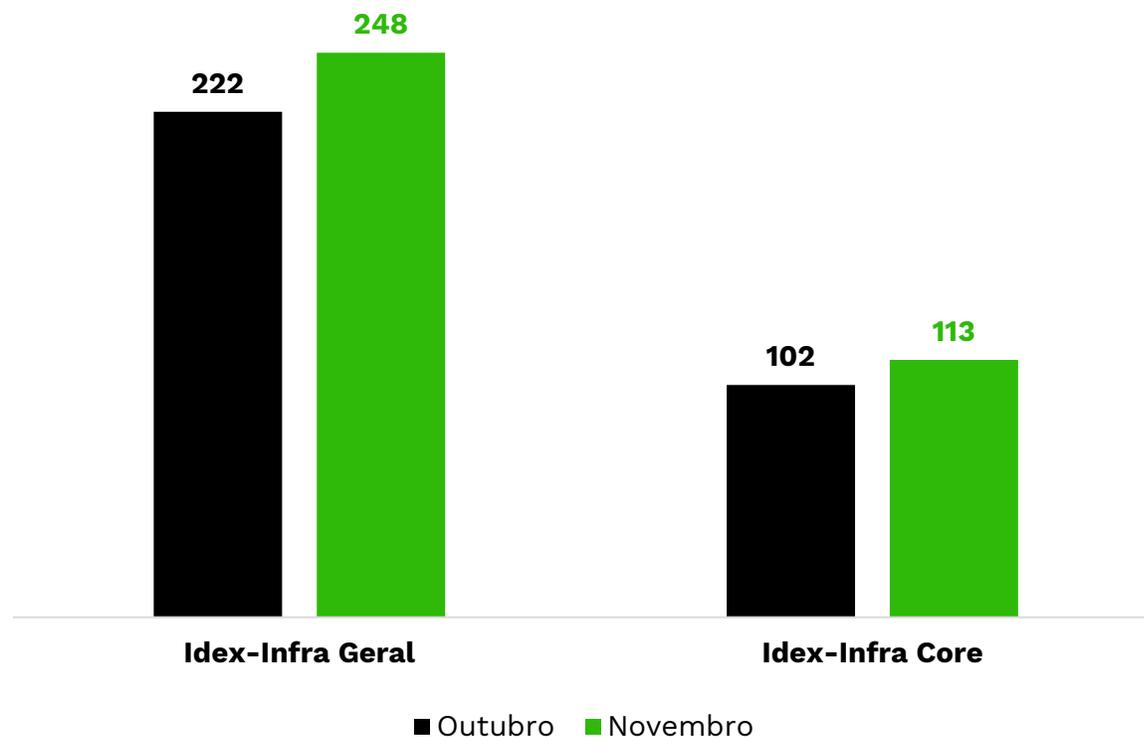
JGP

Idex-Infra JGP

Comentário Mensal — Outubro

Nova Amostra

Alterações nas Amostras



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

Ingressaram no Idex-Infra (32)			Saíram do Idex-Infra (6)
ARTR19	CSNP12	RESA15	ARTR35
CAJS11	CSRNA1	RIS412	GASC22
CEAL21	CTNS14	RIS422	MRS119
CEAP12	ECER12	RISP12	SAPRA3
CEAR26	ELEK37	RISP22	SBSPC4
CEE66	ENEV13	SBSPF9	SBSPD4
CEED12	ENGIB4	TAEAA2	
CEMT19	ESULA1	TRCC11	
CGOS13	ITGT11	VDEN12	
CPFPA0	ITPE12	XNGU17	
CPGT15	POTE11		

Destaques de performance

Idex-Infra Geral

Maiores aberturas de spread (bps over B-ref)

Ativo	02-Out	31-Out	Dif
CAEC21	94,3	148,9	55
PETR25	-51,1	-5,5	46
CSMGA6	45,7	81,0	35
EGIE27	8,9	37,7	29
ENMTA5	42,7	71,0	28

Maiores fechamentos de spread (bps over B-ref)

Ativo	02-Out	31-Out	Dif
ALGA26	58,4	18,4	-40
VBRR11	354,4	318,7	-36
ANET11	404,0	371,9	-32
COCE27	63,8	34,4	-29
SBSPC4	30,6	7,3	-23

Idex-Infra Core

Maiores aberturas de spread (bps over B-ref)

Ativo	02-Out	31-Out	Dif
CAEC21	94,3	148,9	55
PETR25	-51,1	-5,5	46
ASCP23	99,4	122,7	23
ESULA6	49,3	72,2	23
ASCP13	81,5	103,1	22

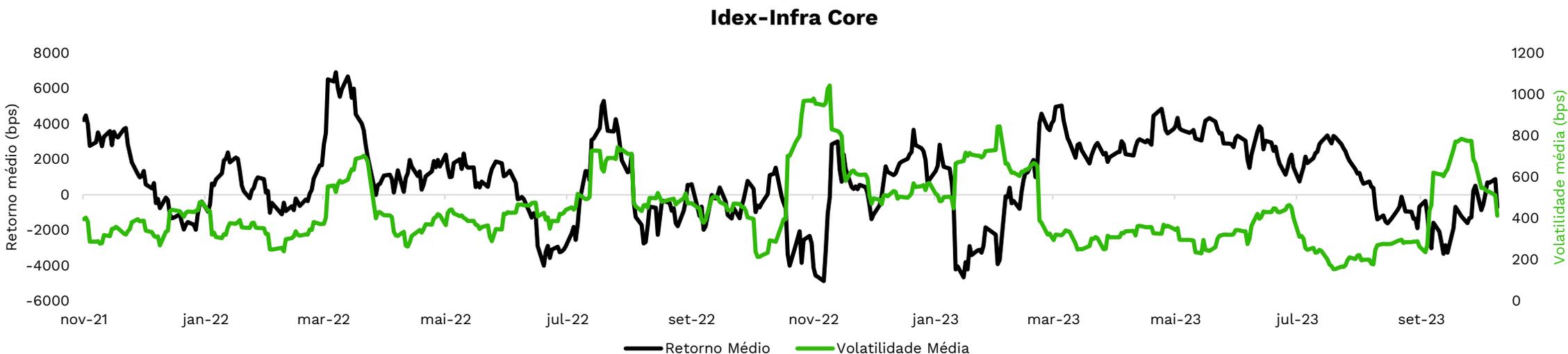
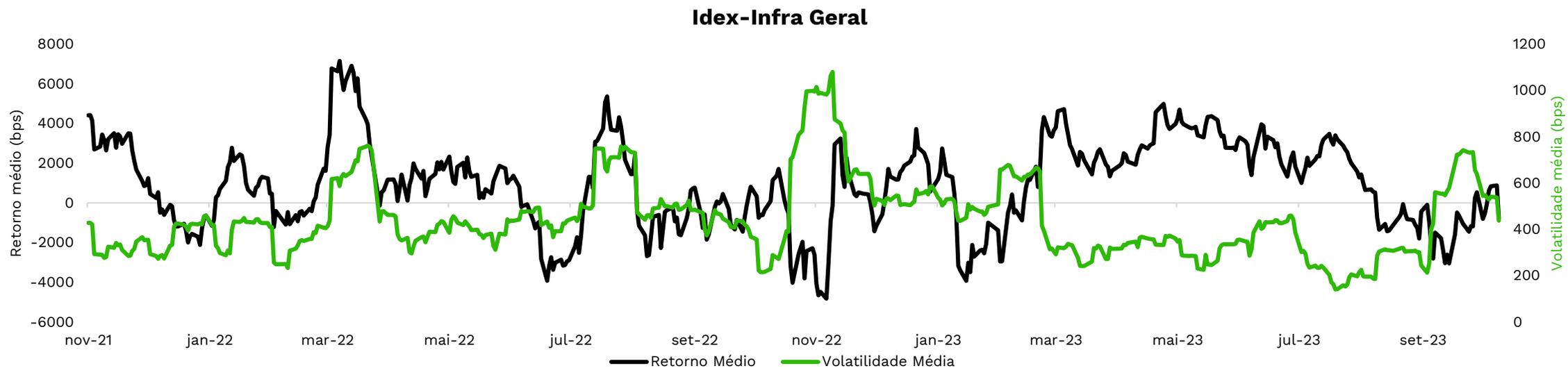
Maiores fechamentos de spread (bps over B-ref)

Ativo	02-Out	31-Out	Dif
COCE27	63,8	34,4	-29
VERO12	287,7	266,8	-21
SBSPB6	55,0	34,4	-21
MRS19	64,3	45,9	-18
TBLE26	54,9	38,8	-16

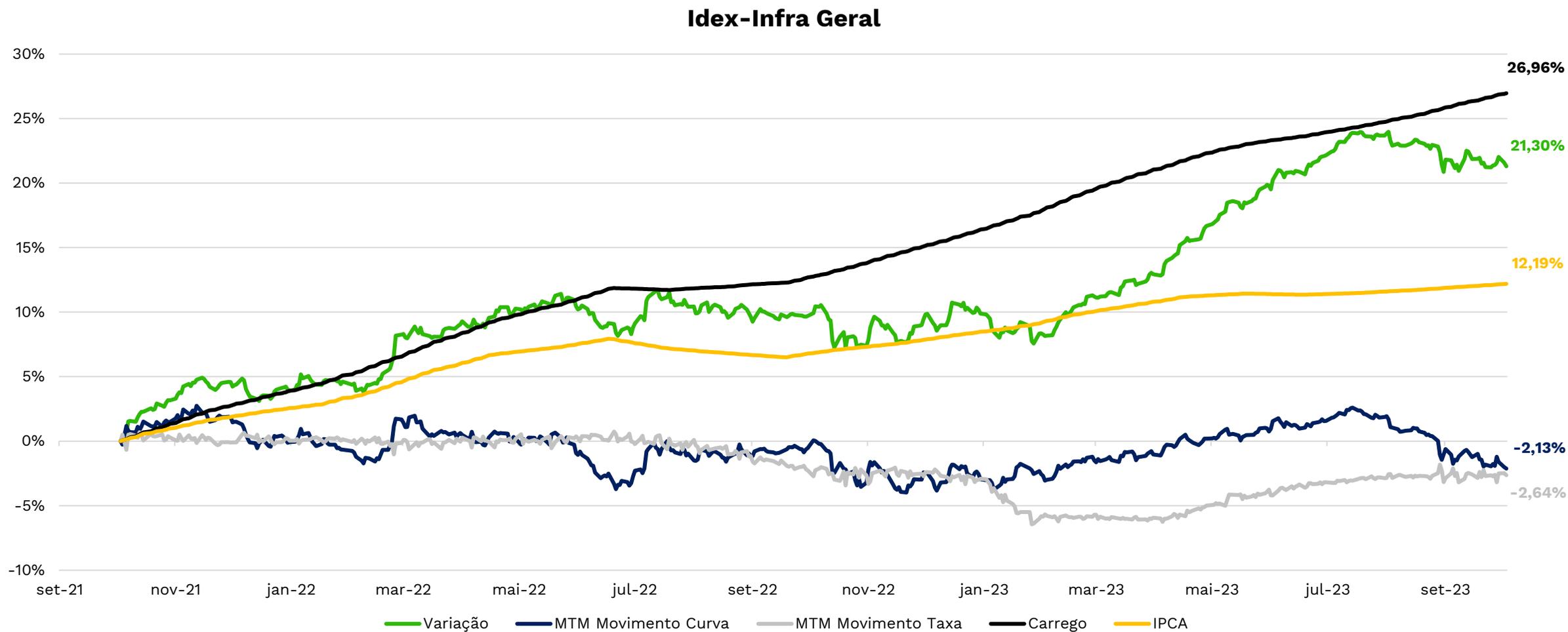
Idex- Infra JGP

Gráficos e Tabelas

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



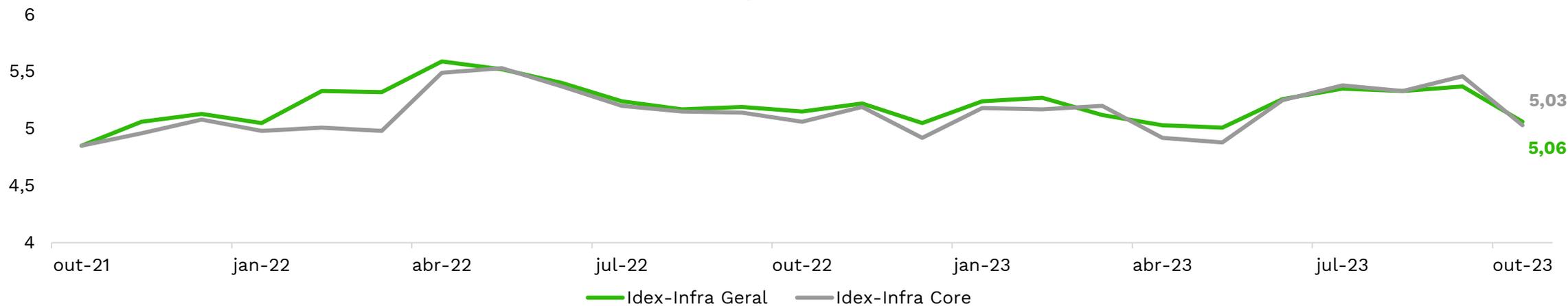
Rentabilidade Acumulada (2 anos)



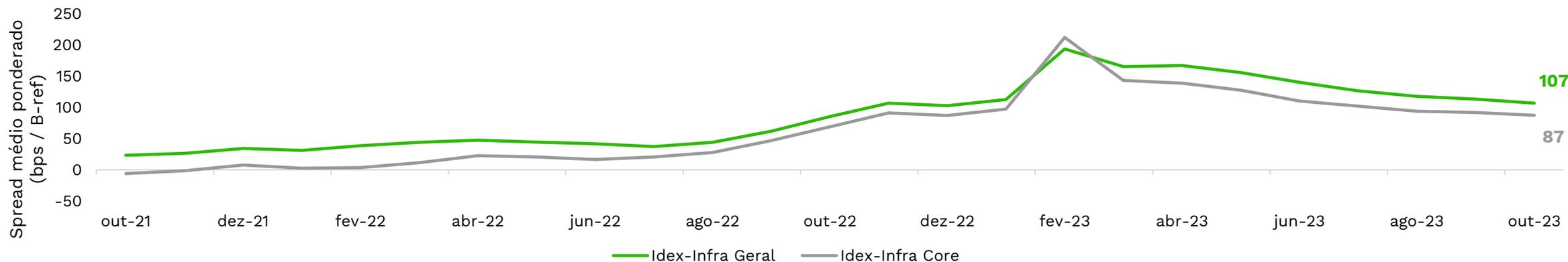
Fonte: JGP

Duration e Spread

Duration to Maturity Ponderada (em anos)

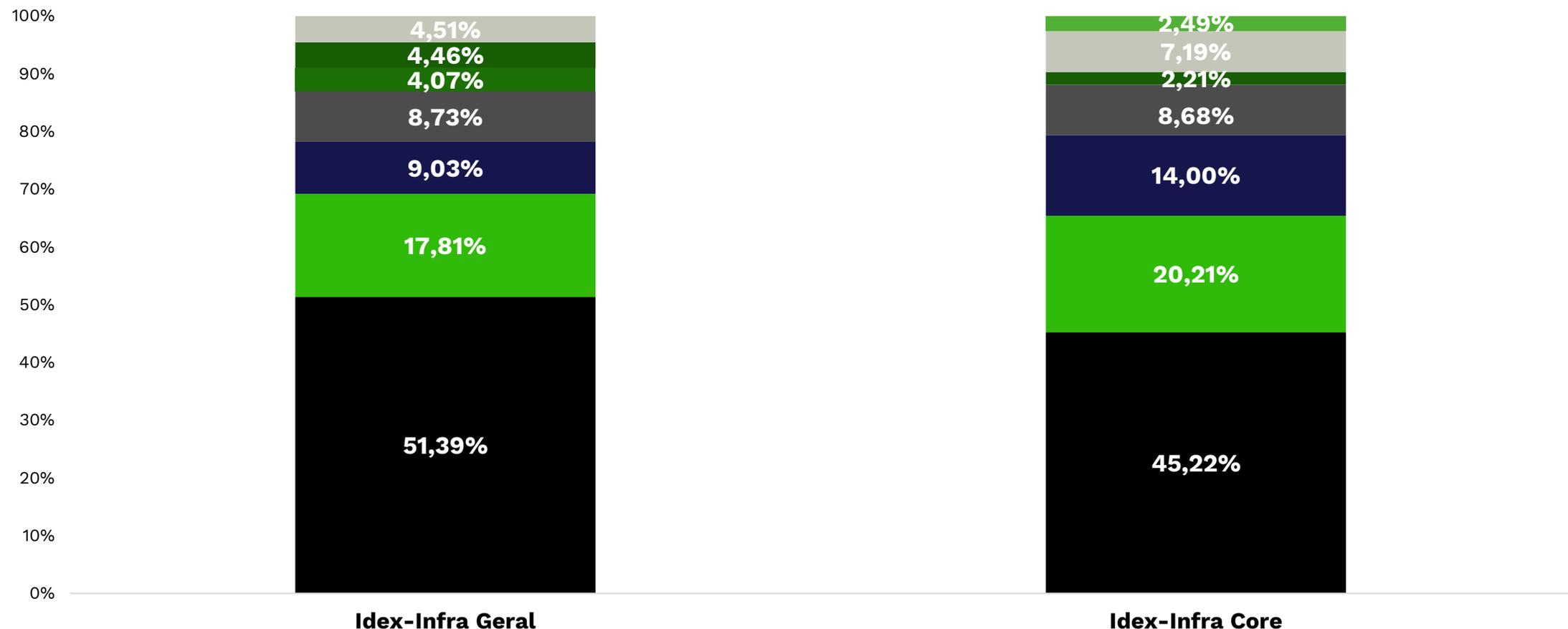


Evolução mensal dos spreads médios: I dex - Infra Geral e I dex - Infra Core



Fonte: JGP

Exposição por Setor (31/10/23)



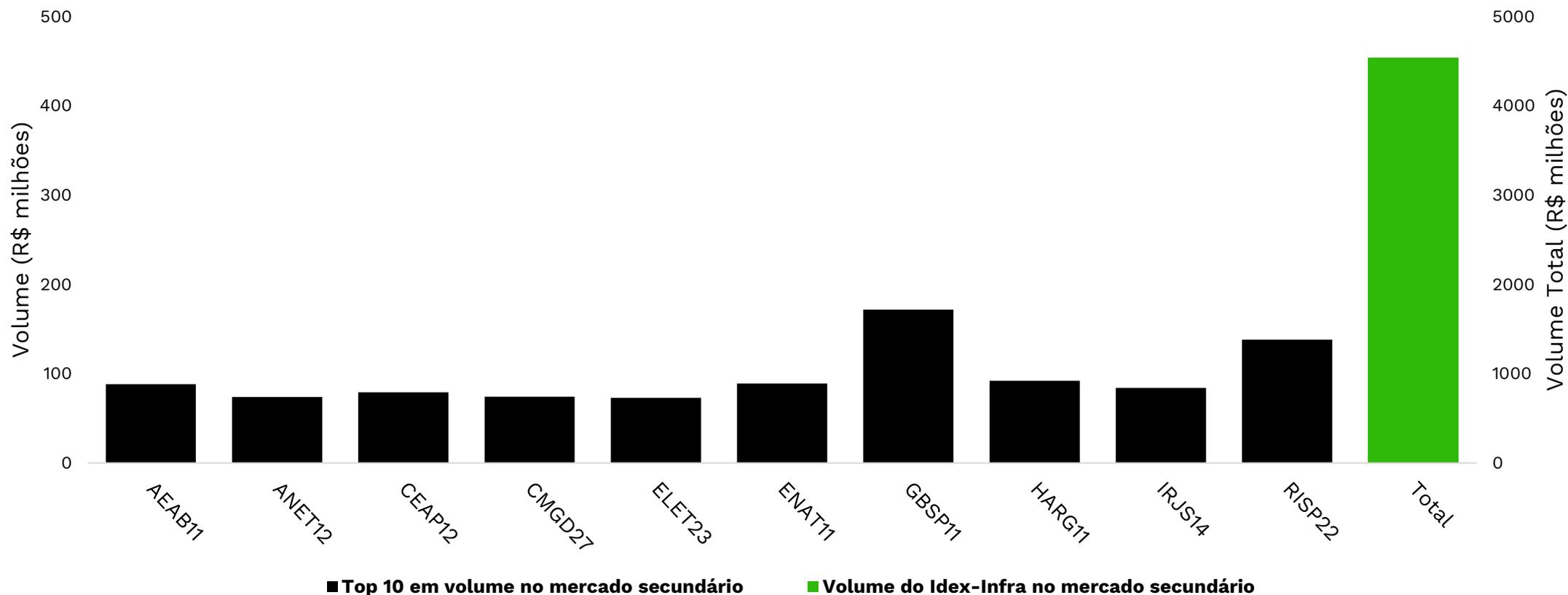
- Energia
- Transporte
- Óleo e Gás
- Utilidade Pública
- Comunicação
- Outros
- Aluguel de Carros e Logística
- Materias Básicas

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 %	-0,42 %			10,41 %
	Idex-Infra Core	-0,01 %	-1,71 %	2,84 %	1,84 %	3,43 %	2,75 %	1,70 %	0,65 %	-1,37 %	-0,48 %			9,91 %
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 (02/10/23 — 31/10/23) 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
ANET12	Americanet	2,88%
ANET11	Americanet	2,41%
GBSP11	Gbs Participacoes S.A.	1,61%
ANEM11	Anemus Wind Holding S.A.	1,51%
VERO12	Vero S.A.	1,11%
I dex-Infra Geral		-0,41%

5 Melhores variações de carregos no período

Ativo	Empresa	Carrego
CPTM15	Ligga Telecomunicacoes	1,18%
ANET11	Americanet	1,10%
ANET12	Americanet	1,07%
NTEN11	Norte Energia	1,06%
VBRR11	Via Brasil	1,06%
I dex-Infra Geral		0,87%

5 Melhores variações a mercado no período

Ativo	Empresa	MTM
ANET12	Americanet	1,79%
ANET11	Americanet	1,29%
GBSP11	Gbs Participacoes S.A.	0,70%
ANEM11	Anemus Wind Holding S.A.	0,50%
OMGE12	Omega Geracao	0,12%
I dex-Infra Geral		-1,27%

5 Piores variações no período

Ativo	Empresa	Variação
IRJS14	Igua Rio De Janeiro S.A.	-1,96%
CSRNC0	Cosern	-1,78%
CBAN32	Rota Das Bandeiras	-1,78%
CAEC21	Cagece	-1,74%
ASCP23	Ecopistas	-1,68%
I dex-Infra Geral		-0,41%

5 Piores variações de carregos no período

Ativo	Empresa	Carrego
PETR17	Petrobras	0,81%
PETR26	Petrobras	0,81%
SBSPD4	Sabesp	0,81%
PETR16	Petrobras	0,81%
SBSPC4	Sabesp	0,81%
I dex-Infra Geral		0,87%

5 Piores variações a mercado no período

Ativo	Empresa	MTM
IRJS14	Igua Rio De Janeiro S.A.	-2,89%
CBAN32	Rota Das Bandeiras	-2,66%
CSRNC0	Cosern	-2,60%
CAEC21	Cagece	-2,59%
ASCP23	Ecopistas	-2,53%
I dex-Infra Geral		-1,27%

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