

Idex

Idex-Infra

Agosto 2024

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,

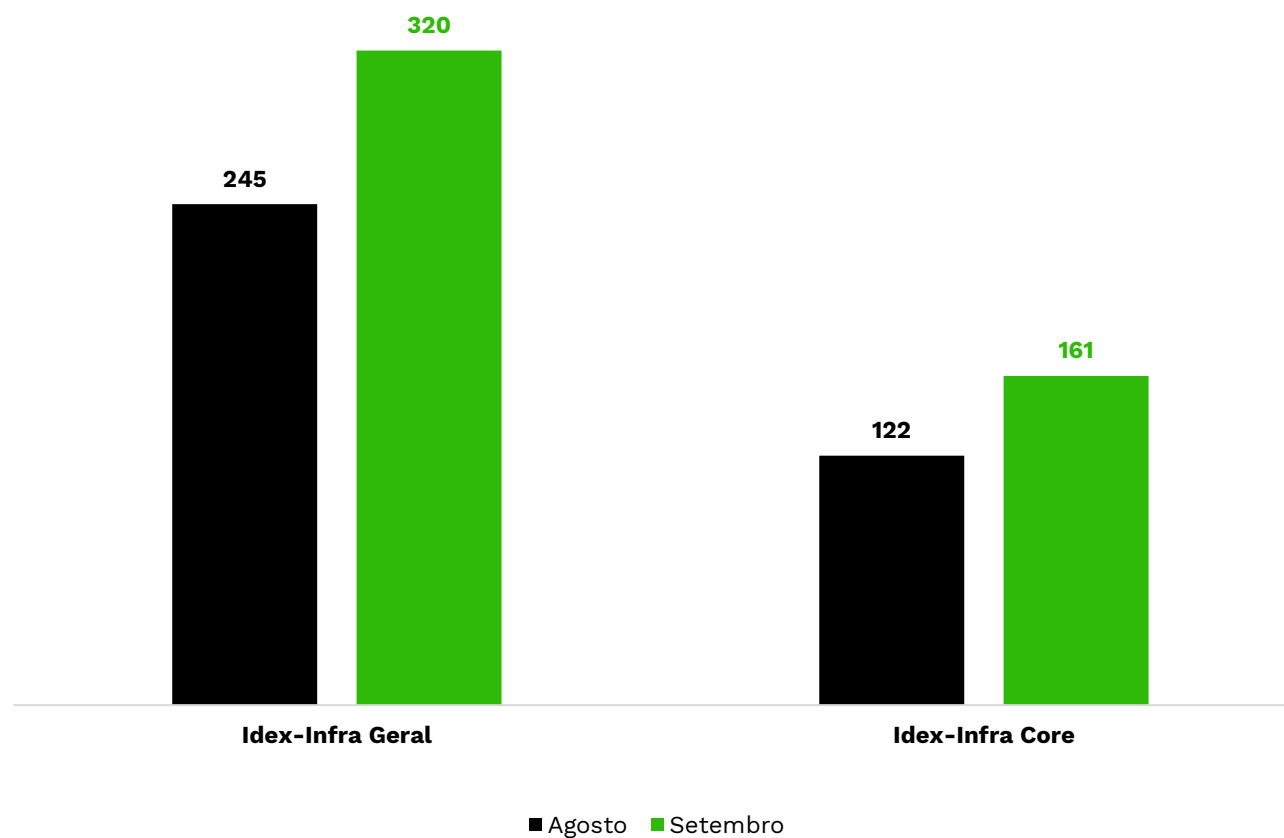
JGP

Idex-Infra JGP

Comentário Mensal — Agosto

Nova Amostra

Alterações nas Amostras



Nova Amostra

Alterações no Índice- Idex-Infra Geral

(1-Ago — 1-Set)

Ingressaram no Idex-Infra (80)

AESLA7	CPFPA7	EEELA1	ENEV39	IRJS15	PRPO12	SAPRB3	VERO13
AESLB7	CPGT27	EEELB1	EQTR11	JALL14	RDOE18	SDMH11	VLIM13
ALGE16	CPLD26	EGIE49	ERDVA4	JALL15	RECV11	STRZ11	VLIM14
AURE12	CPLD29	EKTRB3	ERDVB4	JTEE12	RIS424	TAEAA4	
BCPSA5	CPLD37	EKTT11	ERDVC4	MGSP12	RISP24	TBEG11	
CBAN72	CSNAA5	ELPLA5	ESULA6	NTEN11	RRRP13	TCII11	
CCLS21	CSNAB5	ENAT13	ETSP12	ORIG11	RUMOA5	TIET18	
CCROA5	CSRN19	ENAT14	GASC16	PEJA23	RUMOA6	TIET29	
CGOS16	CSRNA1	ENAT24	GASC23	PETR27	RUMOB7	TIET39	
CHSF13	CSRNB2	ENEV16	GASC26	POTE11	SAELA3	TPNO13	
CPFGA2	EDPA11	ENEV26	GBSP11	PPTE11	SAPRA2	TSSG21	

Saíram do Idex-Infra (5)

CPFPA0
ELET23
ESULA1
ITGT11
PETR16

Destques de performance

Idex-Infra Geral

Maiores aberturas de spread (bps over B-ref)

Ativo	01-Ago-24	30-Ago-24	Dif
ENAT11	102,5	445,8	343
IRJS14	158,7	358,7	200
SAPR10	-25,6	-6,9	19
ALGAC2	79,6	95,6	16
CPTM15	475,1	490,9	16

Maiores fechamentos de spread (bps over B-ref)

Ativo	01-Ago-24	30-Ago-24	Dif
MTRJ19	156	85,4	-71
APPSA2	90,4	50,3	-40
VERO12	211	173,2	-38
ENEV32	19,3	-16	-35
PLSB1A	68,7	34,4	-34

Idex-Infra Core

Maiores aberturas de spread (bps over B-ref)

Ativo	01-Ago-24	30-Ago-24	Dif
ENAT11	102,5	445,8	343
IRJS14	158,7	358,7	200
QUAT12	33,4	67,8	34
SAPR10	-25,6	-6,9	19
VDEN12	-13,5	4,8	18

Maiores fechamentos de spread (bps over B-ref)

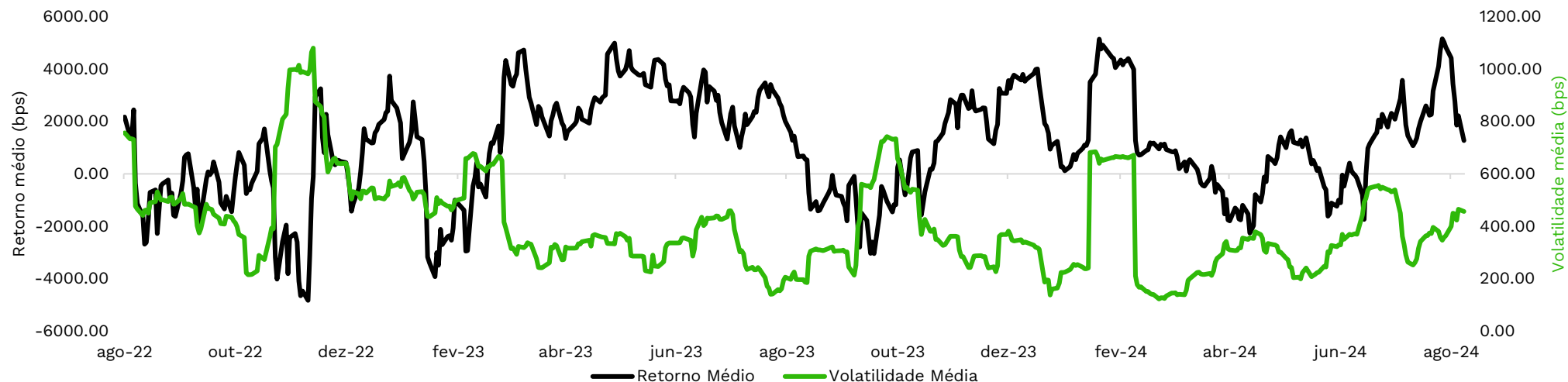
Ativo	01-Ago-24	30-Ago-24	Dif
CASN23	332,5	240,8	-92
MTRJ19	156	85,4	-71
ANET12	230,5	172,7	-58
COMR14	97,9	40,5	-57
ANET11	205,6	154,2	-51

Idex- Infra JGP

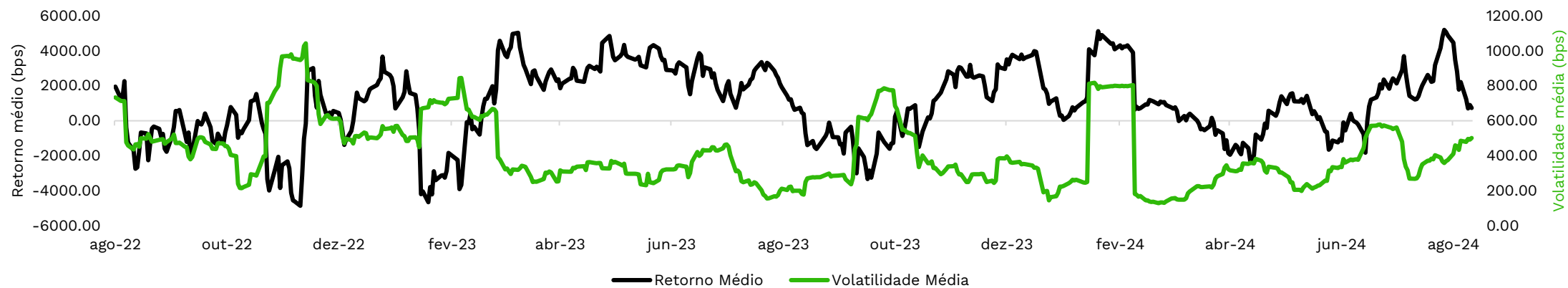
Gráficos e Tabelas

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

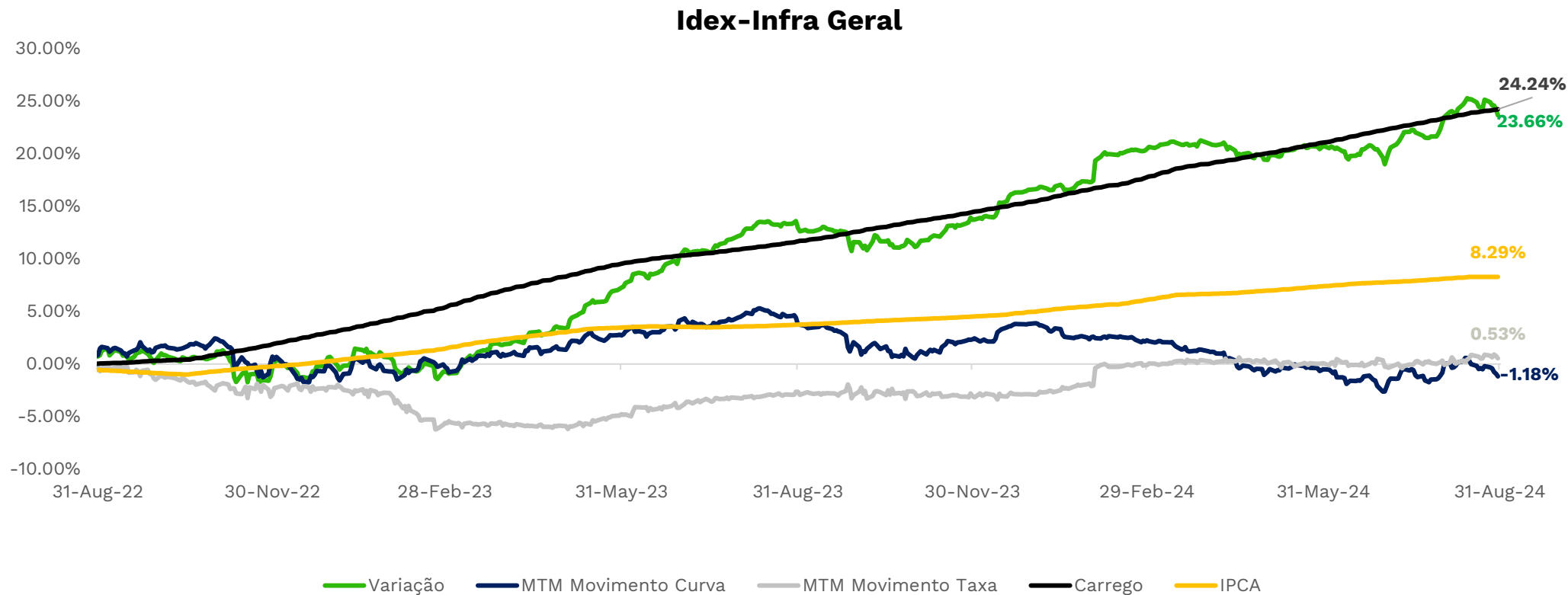
Idex-Infra Geral



Idex-Infra Core

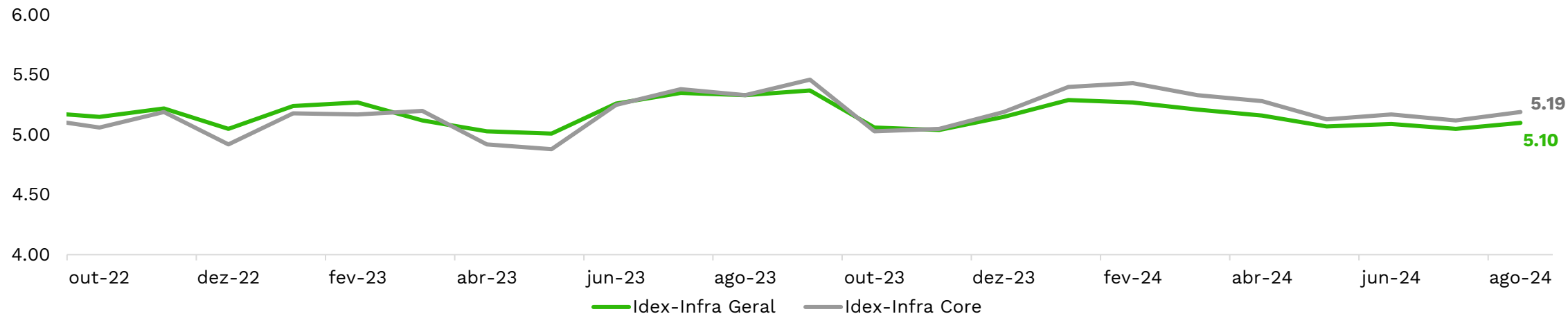


Rentabilidade Acumulada (2 anos)

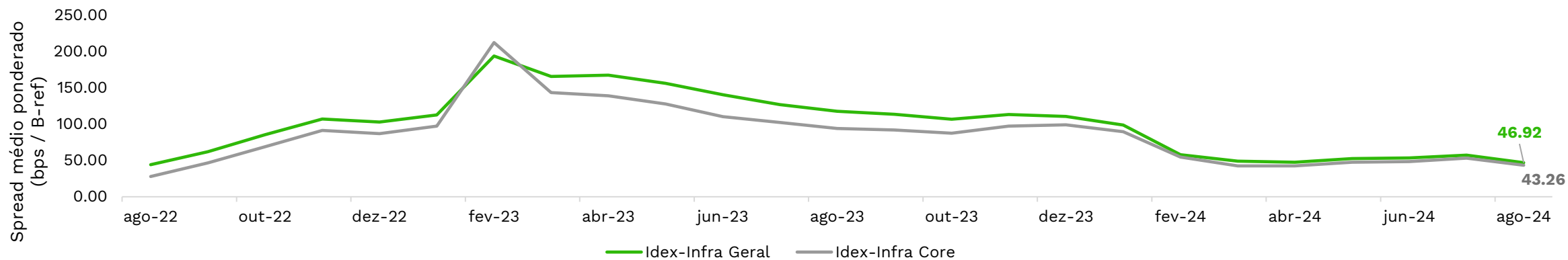


Duration e Spread

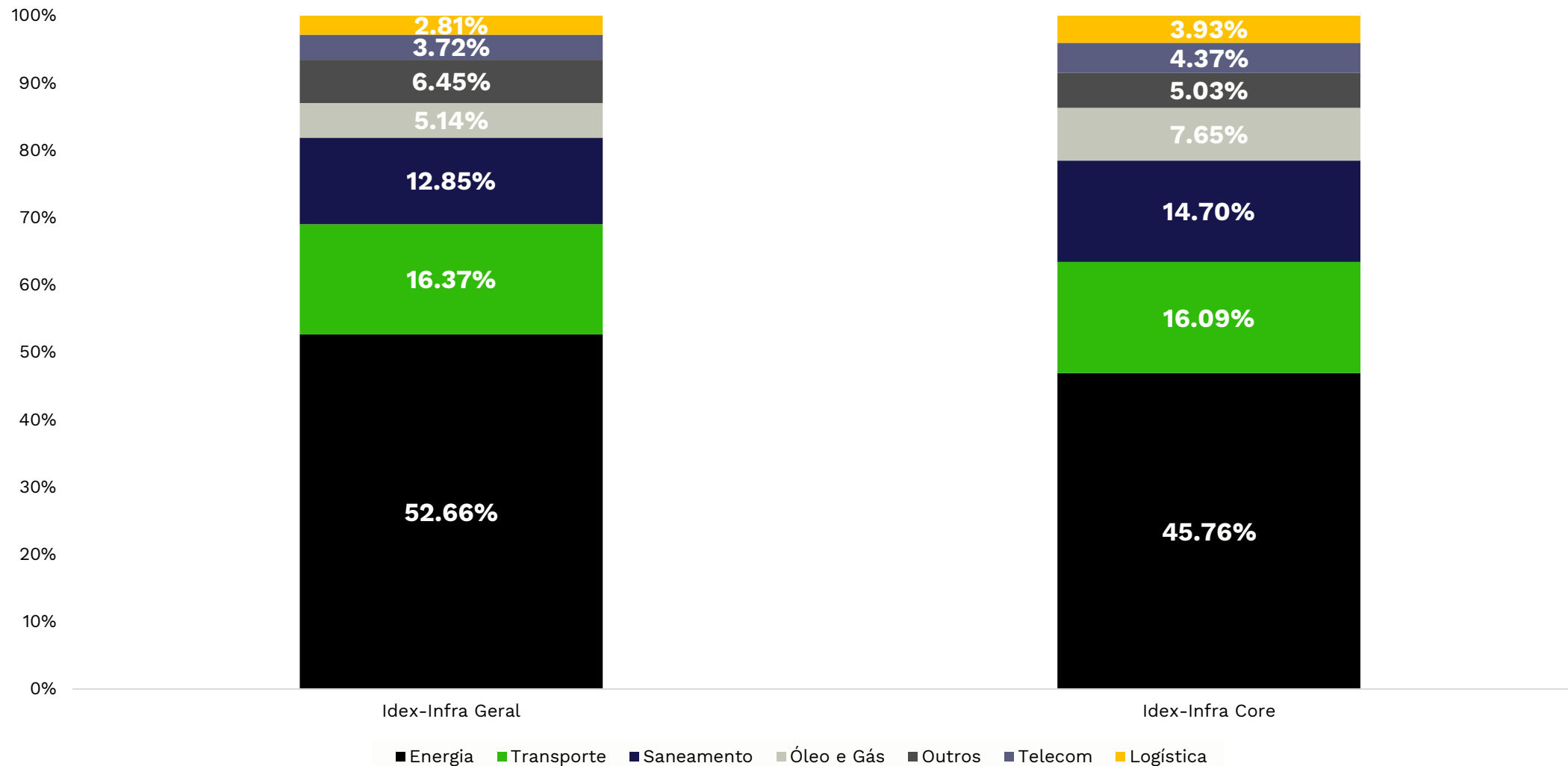
Duration to Maturity Ponderada (em anos)



Evolução dos Spreads de Carregos Médios Ponderados (em IPCA+)



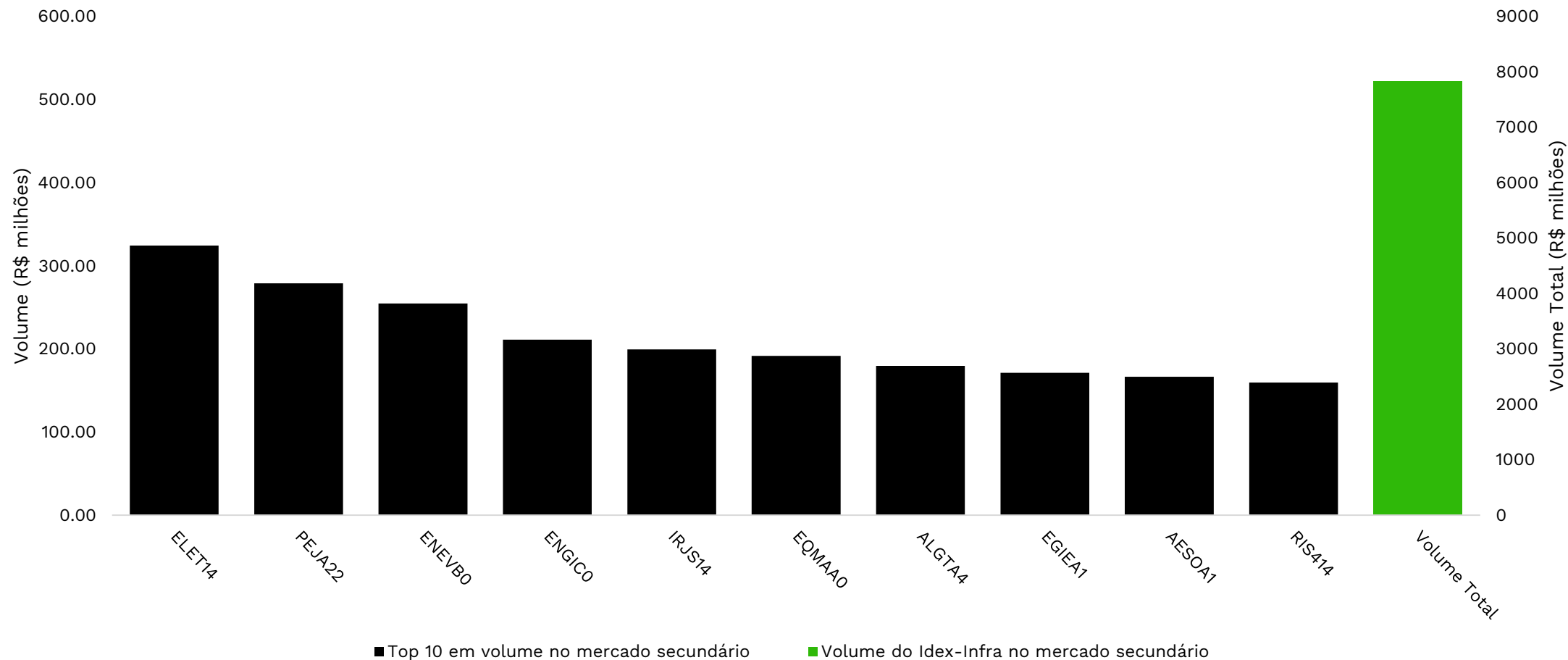
Exposição por Setor (30/08/24)



Histórico de Performance

Ano		Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Acum Ano
2024	Idex-Infra Geral	0,63 %	2,70 %	0,67 %	-1,50 %	1,10 %	-0,26 %	1,59 %	1,06%					6,09 %
	Idex-Infra Core	0,61 %	2,66 %	0,63 %	-1,60 %	1,09 %	-0,30 %	1,62 %	0,86%					5,86 %
2023	Idex-Infra Geral	-0,19 %	-1,19 %	2,62 %	1,55 %	3,66 %	2,71 %	1,83 %	0,69 %	-1,19 %	-0,42 %	2,31 %	2,50%	15,79 %
	Idex-Infra Core	-0,01 %	-1,71 %	2,84 %	1,84 %	3,43 %	2,75 %	1,70 %	0,65 %	-1,37 %	-0,48 %	2,31 \$	2,51%	15,27 %
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 %

Volume no Secundário das Debêntures da Amostra (01/08/24 — 30/08/24) em R\$ milhões



Idex-Infra Geral — Tabelas de Atribuição de Performance

- Variação total: carregamento + marcação a mercado
- Variações de carregamento: retorno obtido por carregar o papel em sua taxa de indicativa
- Variações de marcação a mercado: reflete ganhos/perdas no preço das debêntures referentes a fechamento/abertura das taxas indicativas

5 Melhores variações no período

Ativo	Empresa	Variação
CASN23	Casan	4,76%
COMR15	Comerc Participacoes	4,69%
COMR14	Comerc Participacoes	4,67%
ITPO14	Itapoa Terminais Portuarios S.A.	3,42%
GASC25	Rumo Malha Paulista	3,34%
IDEX-Infra Geral		1,07%

5 Piores variações no período

Ativo	Empresa	Variação
IRJS14	Igua Rio De Janeiro S.A.	-14,20%
ENAT11	Enauta Participacoes S.A.	-8,68%
CTGE13	Eletrosul	-0,05%
ALGAC2	Algar Telecom	0,06%
PALFB3	Companhia Paulista De Forca E Luz	0,47%
IDEX-Infra Geral		1,07%

5 Melhores variações de carregos no período

Ativo	Empresa	Variação
CPTM15	Ligga Telecomunicacoes	1,14%
CASN23	Casan	0,95%
ANET12	Americanet	0,91%
ANET11	Americanet	0,91%
VERO12	Vero	0,90%
IDEX-Infra Geral		0,76%

5 Piores variações de carregos no período

Ativo	Empresa	Variação
PETR26	Petrobras	0,71%
PETR16	Petrobras	0,71%
GASP19	Comgas	0,71%
CPFPA0	Cpfl Piratininga	0,71%
IEMD12	Interligação Elétrica Do Madeira	0,71%
IDEX-Infra Geral		0,76%

5 Melhores variações a mercado no período

Ativo	Empresa	Variação
COMR15	Comerc Participacoes	3,88%
COMR14	Comerc Participacoes	3,86%
CASN23	Casan	3,78%
ITPO14	Itapoa Terminais Portuarios S.A.	2,64%
GASC25	Rumo Malha Paulista	2,59%
IDEX-Infra Geral		0,31%

5 Piores variações a mercado no período

Ativo	Empresa	Variação
IRJS14	Igua Rio De Janeiro S.A.	-14,94%
ENAT11	Enauta Participacoes S.A.	-9,44%
CTGE13	Eletrosul	-0,78%
ALGAC2	Algar Telecom	-0,71%
CPTM15	Ligga Telecomunicacoes	-0,60%
IDEX-Infra Geral		0,31%

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