

# Idex

Idex-Infra

**Outubro 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**

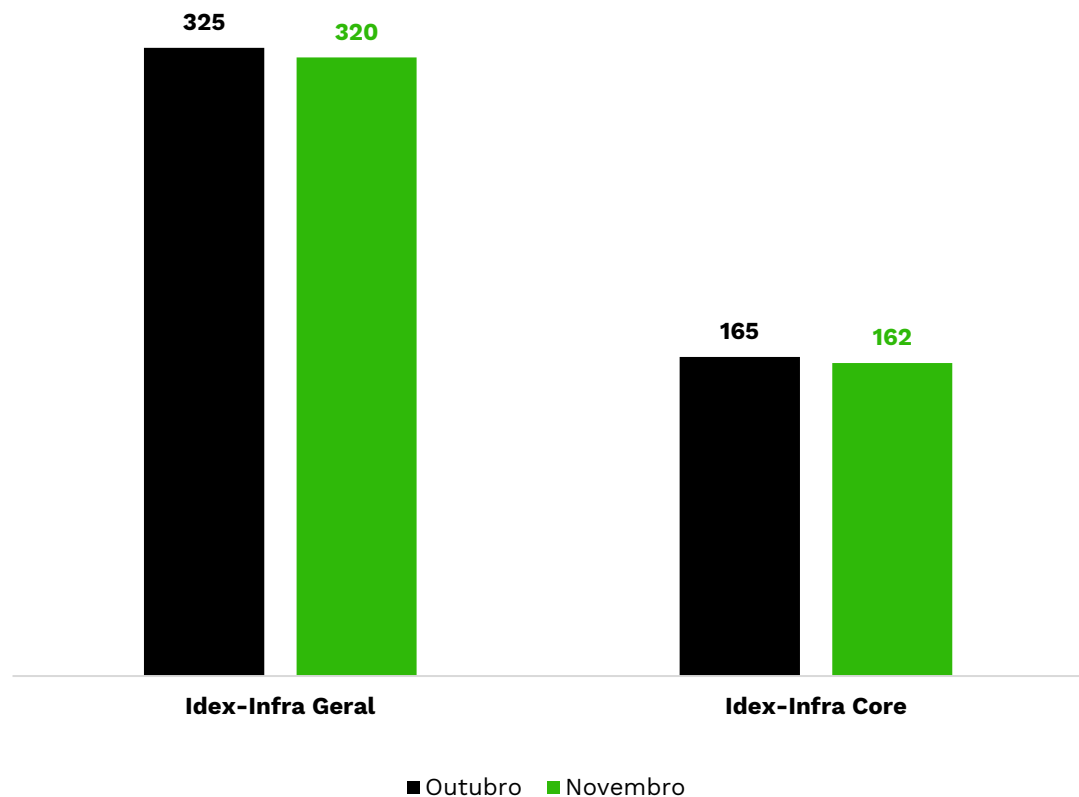
**Idex-Infra JGP**

---

# **Comentário Mensal — Outubro**

# Nova Amostra

## Alterações nas Amostras



## Alterações no Índice - Idex-INFRA Geral (01/Out a 01/Nov)

Ingressaram no Idex-Infra (6)	Saíram do Idex-Infra (11)
BARU11	CPLD26 ETEN31
CEED15	ELPLA5 MNAU13
EGIEA0	ELPLA7 RMSA12
KLBNA5	ELPLB4 RUMOB6
SERI11	ENGIA9 TAEE17
SUMI17	ETAP22

# Destques de performance

## Idex-Infra Geral

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

Ativo	01-out-24	31-out-24	Dif
ELPLA5	26,6	208,4	182
ELPLB4	-19,9	124,6	144
ODTR11	-8,8	76,4	85
COCE18	14,4	77,5	63
QUAT12	75,9	136,3	60

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

Ativo	01-out-24	31-out-24	Dif
ANET11	162,7	106,8	-56
VERO12	171,7	126,3	-45
PRPO12	56,4	16	-40
XNGU17	39,3	0,7	-39
SBSPB6	-12	-49,4	-37

## Idex-Infra Core

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

Ativo	01-out-24	31-out-24	Dif
ELPLA5	26,6	208,4	182
ELPLB4	-19,9	124,6	144
ODTR11	-8,8	76,4	85
COCE18	14,4	77,5	63
APPSA2	-1,5	42,8	44

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

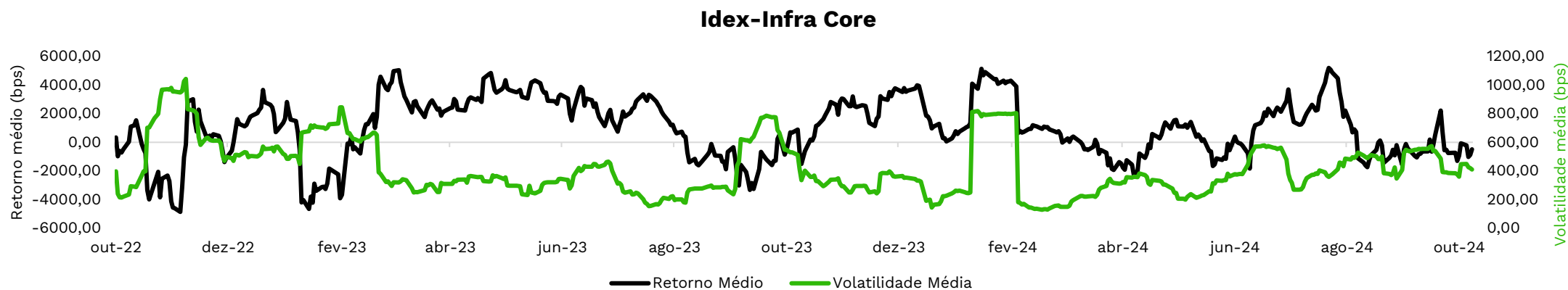
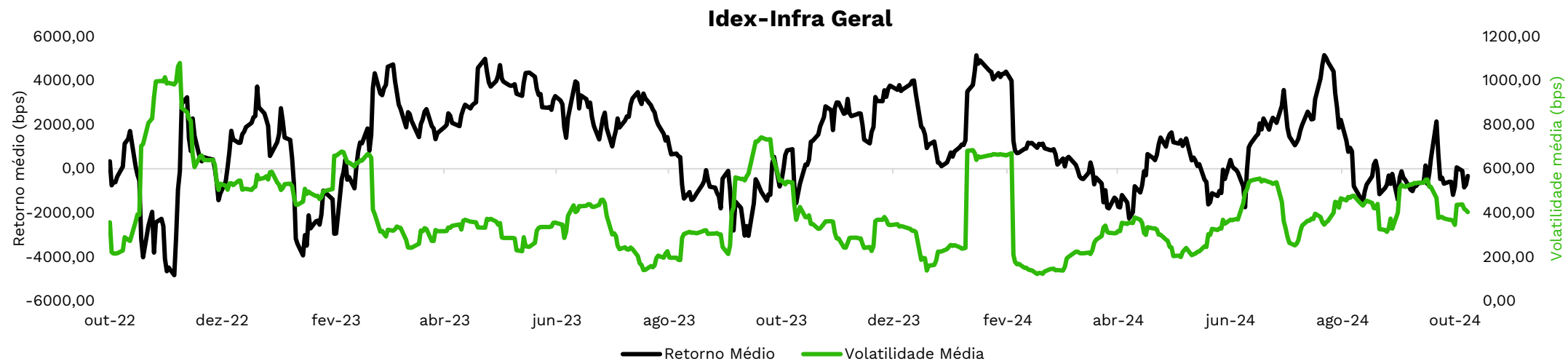
Ativo	01-out-24	31-out-24	Dif
VERO12	171,7	126,3	-45
SBSPB6	-12	-49,4	-37
VERO13	196,5	162,3	-34
CPFGA2	31,8	1,2	-31
CCROA5	25,7	-1,6	-27

**Idex- Infra JGP**

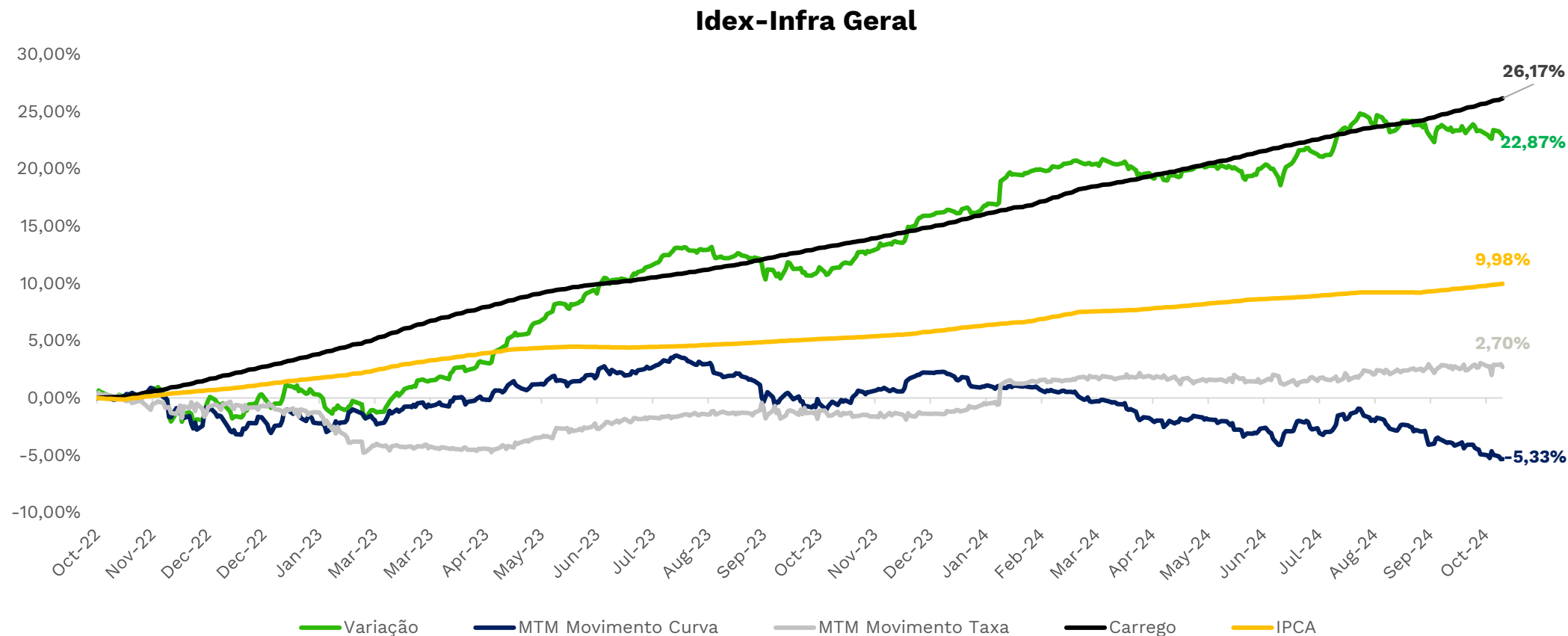
---

# Gráficos e Tabelas

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

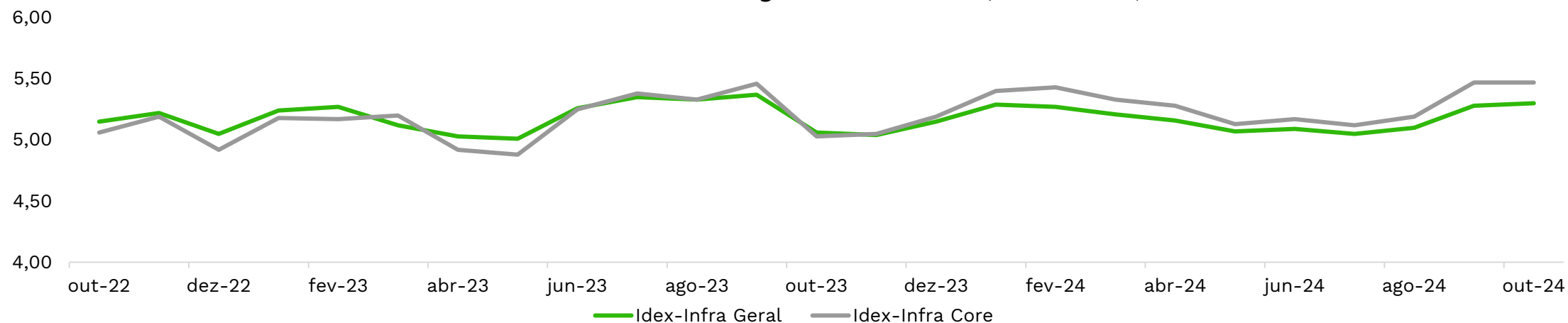


# Rentabilidade Acumulada (2 anos)

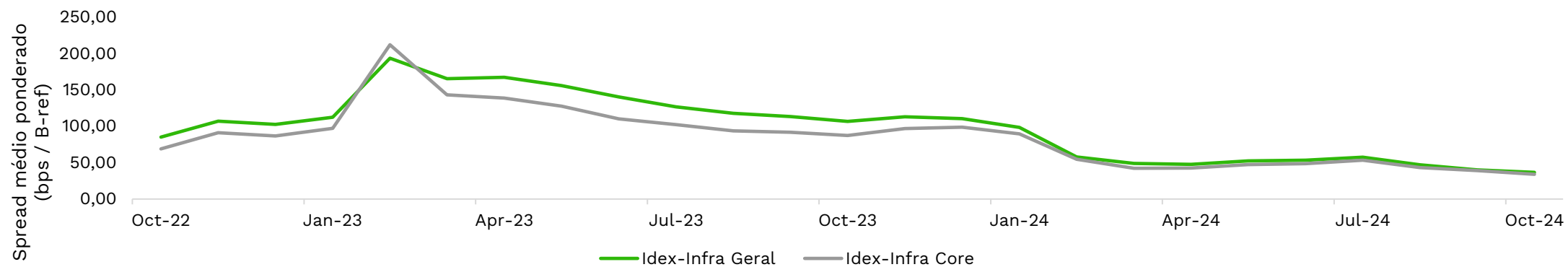


# Duration e Spread

### Duration to Maturity Ponderada (em anos)

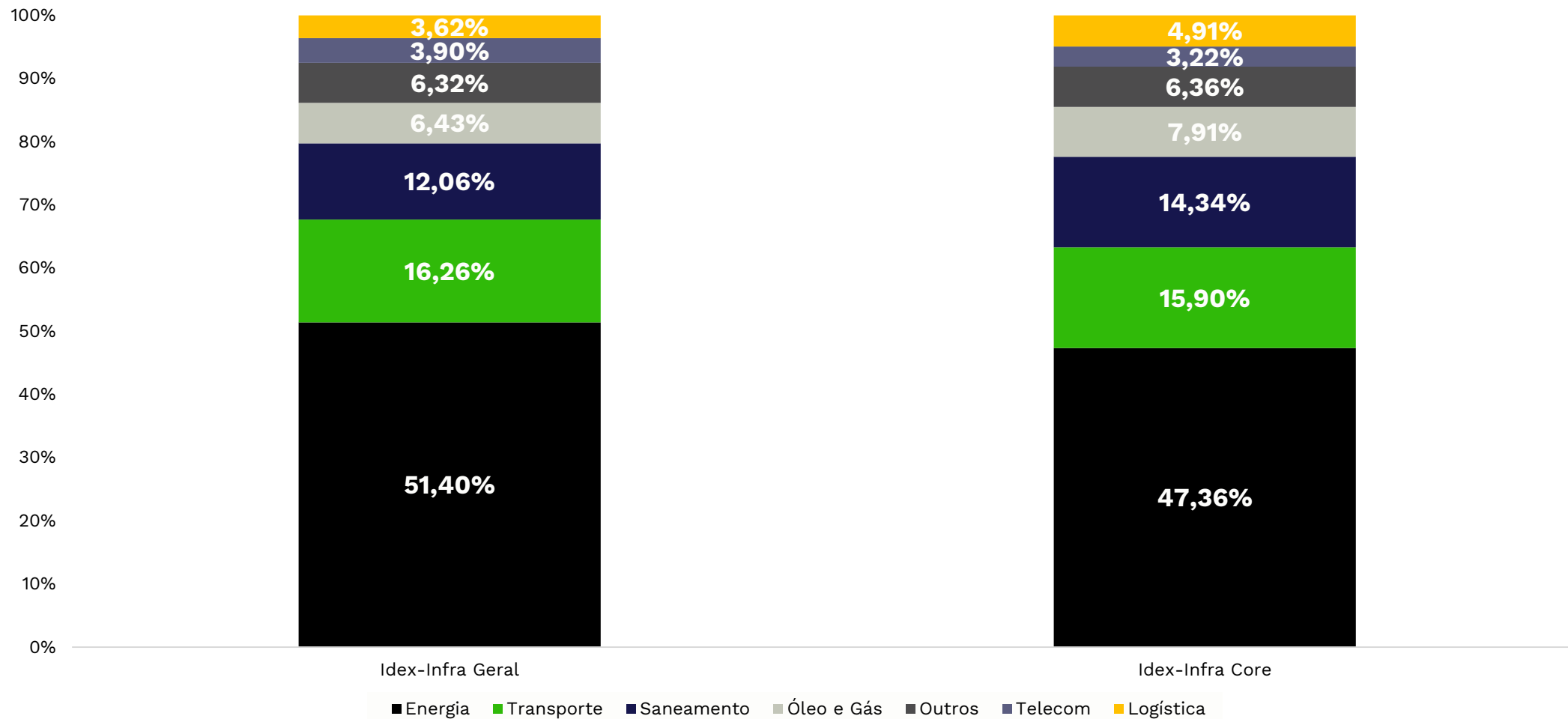


### Evolução dos Spreads de Carregos Médios Ponderados (em IPCA+)





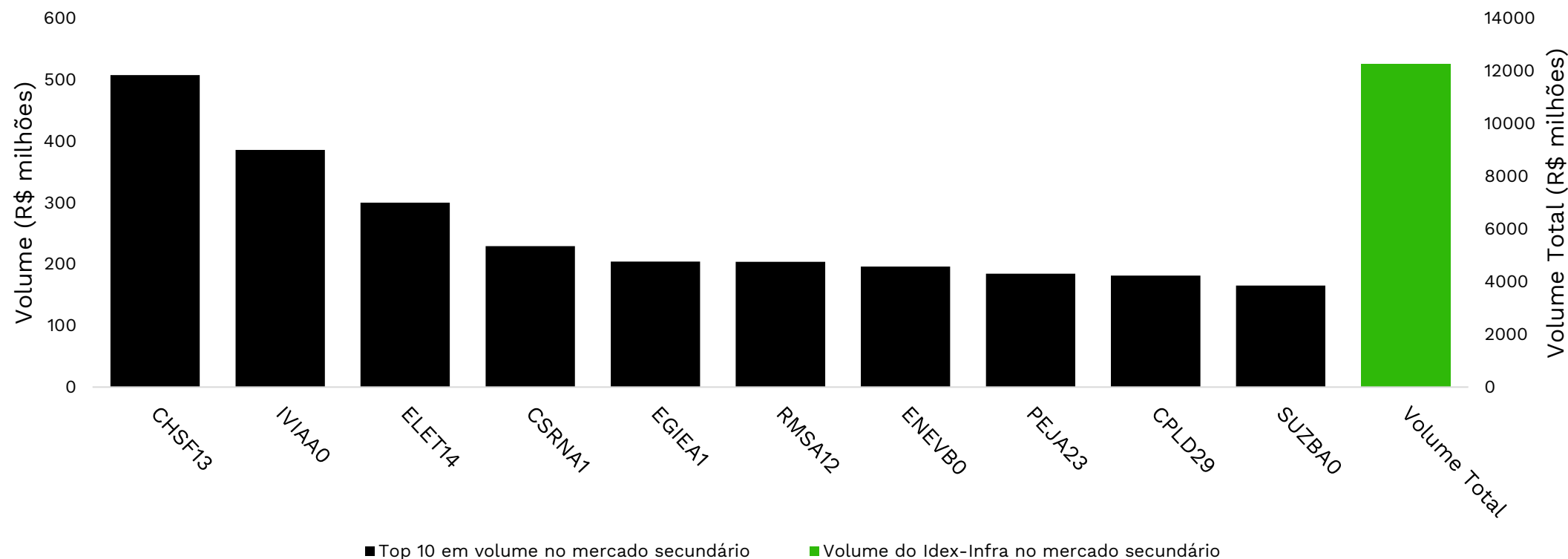
# Exposição por Setor (31/10/24)



# Histórico de Performance

Ano		Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Acum Ano
2024	Iindex-Infra Geral	0,63 %	2,70 %	0,67 %	-1,50 %	1,10 %	-0,26 %	1,59 %	1,06%	0,20 %	-0,48%			5,80 %
	Iindex-Infra Core	0,61 %	2,66 %	0,63 %	-1,60 %	1,09 %	-0,30 %	1,62 %	0,86%	0,27 %	-0,60%			5,30 %
2023	Iindex-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 %
	Iindex-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	Iindex-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 %
	Iindex-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 (01/10/24 — 31/10/24) 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
VERO13	Vero	2,70%
PRPO12	Pirapora li Solar Holding S.A.	2,40%
VERO12	Vero	2,00%
ANET11	Americanet	1,94%
SBSPB6	Sabesp	1,52%
<b>IDEX-Infra Geral</b>		<b>-0,47%</b>

## 5 Melhores variações de carregos no período

Ativo	Empresa	Variação
CASN23	Casan	1,31%
NTEN11	Norte Energia	1,30%
VBRR11	Via Brasil	1,29%
ORIG11	Origem Energia S.A.	1,28%
VERO13	Vero	1,28%
<b>IDEX-Infra Geral</b>		<b>1,14%</b>

## 5 Melhores variações a mercado no período

Ativo	Empresa	Variação
VERO13	Vero	1,40%
PRPO12	Pirapora li Solar Holding S.A.	1,22%
VERO12	Vero	0,74%
ANET11	Americanet	0,71%
ETAP22	Etap	0,47%
<b>IDEX-Infra Geral</b>		<b>-1,59%</b>

## 5 Piores variações no período

Ativo	Empresa	Variação
ELPLA5	Eletropaulo	-8,79%
COCE18	Coelce	-3,79%
RMSA12	Brk Ambiental	-3,35%
AESLB7	Rge Sul	-3,27%
SAELB3	Energisa Paraiba	-3,02%
<b>IDEX-Infra Geral</b>		<b>-0,47%</b>

## 5 Piores variações de carregos no período

Ativo	Empresa	Variação
IEMD12	Interligação Elétrica Do Madeira	0,98%
CPGT26	Copel Geracao E Transmissao	1,00%
CTEE17	Cteep	1,00%
EGIE17	Engie Brasil	1,01%
CEPE19	Celpe	1,01%
<b>IDEX-Infra Geral</b>		<b>1,14%</b>

## 5 Piores variações a mercado no período

Ativo	Empresa	Variação
ELPLA5	Eletropaulo	-9,88%
COCE18	Coelce	-4,86%
RMSA12	Brk Ambiental	-4,50%
AESLB7	Rge Sul	-4,32%
IRJS14	Igua Rio De Janeiro S.A.	-4,13%
<b>IDEX-Infra Geral</b>		<b>-1,59%</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