

Idex

Idex-CDI

Fevereiro 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,

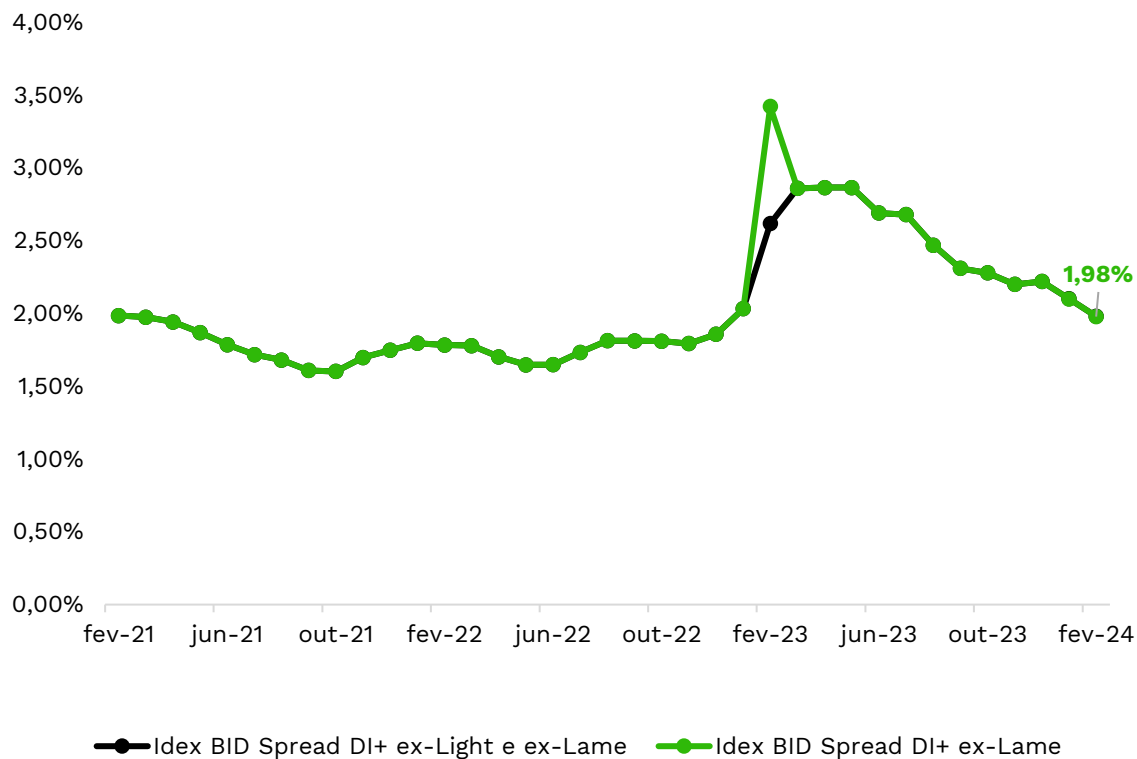
JGP

Idex-CDI JGP

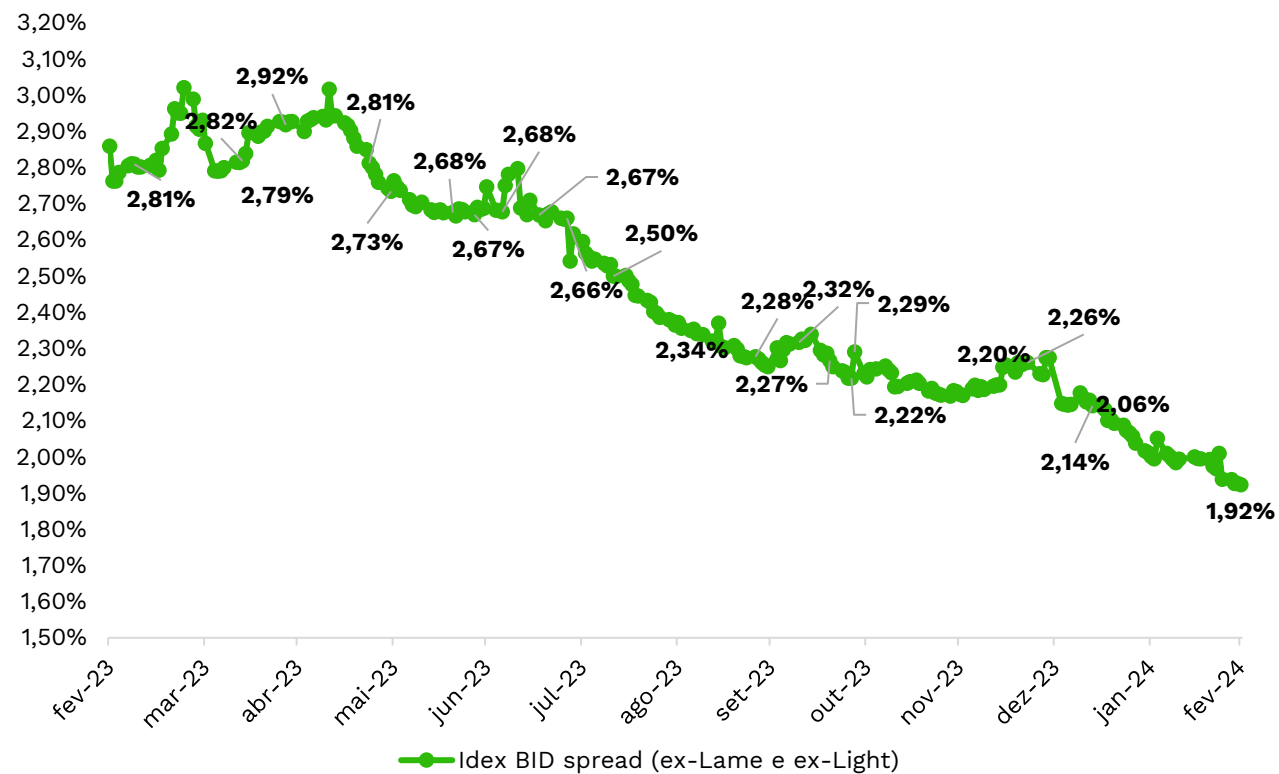
Comentário Mensal — Fevereiro

Comentário Mensal

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

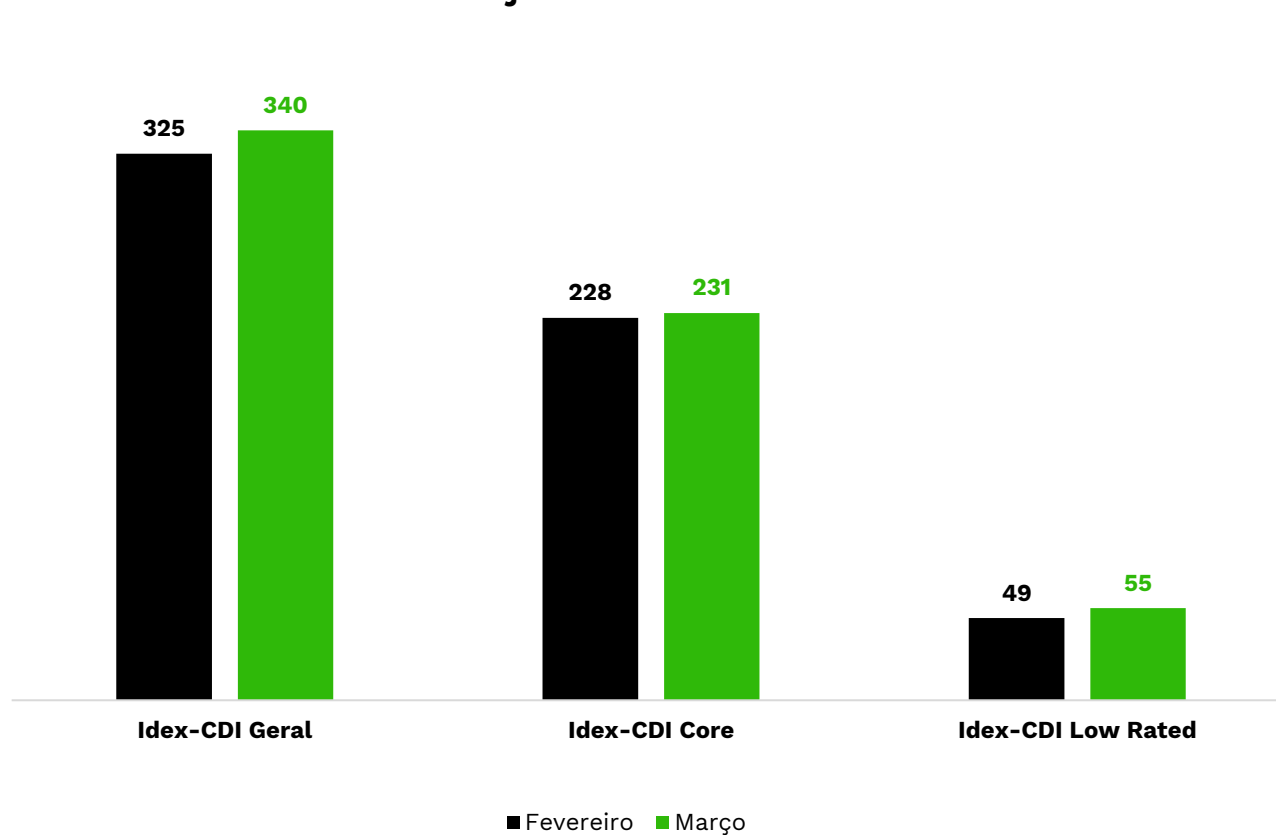


Evolução do *spread* diário do Idex-CDI (ex-Lame e Light)



Nova Amostra

Alterações na Amostra



Alterações no Índice - Idex-CDI Geral (29-Feb — 1-Mar)

Ingressaram no Idex-CDI (23)		Saíram do Idex-CDI (8)
AETE11	GUAR24	CAMLA1
ALSR12	LMTP18	CLCD14
ALTF11	MRVEA8	CTEEA2
CAEC11	ONCO29	DASAA8
CBRDB8	OVSA1A	DASAB4
CGBP13	PRLG16	ERDV18
CIME12	RSAN25	VAMO12
CLOR12	SBSPE8	VAMO24
CMPH14	TEND17	
COGN27	TEND19	
CSRR11	VVEO16	
DASAB0		

Destques de performance

Maiores aberturas de spread %DI

Ativo	1-Feb	29-Feb	Dif
DASAC0	129,00%	135,00%	6,00%
DASAA1	129,00%	132,00%	3,00%
UNDAC2	117,00%	117,50%	0,50%

Maiores fechamentos de spread %DI

Ativo	01-fev	29-fev	Dif
LORTD4	115,00%	113,00%	-2,00%
KLBNA2	111,50%	110,50%	-1,00%
CPGT16	106,50%	105,50%	-1,00%

Maiores aberturas de spread DI+

Ativo	1-Feb	29-Feb	Dif
JHSFA1	2,20%	3,35%	1,15%
AERI12	9,95%	10,75%	0,80%
DASAC5	3,20%	3,70%	0,50%

Maiores fechamentos de spread DI+

Ativo	1-Feb	29-Feb	Dif
CBRDA8	10,50%	8,00%	-2,50%
BRKMA8	6,20%	3,85%	-2,35%
BRKMA6	6,15%	4,00%	-2,15%

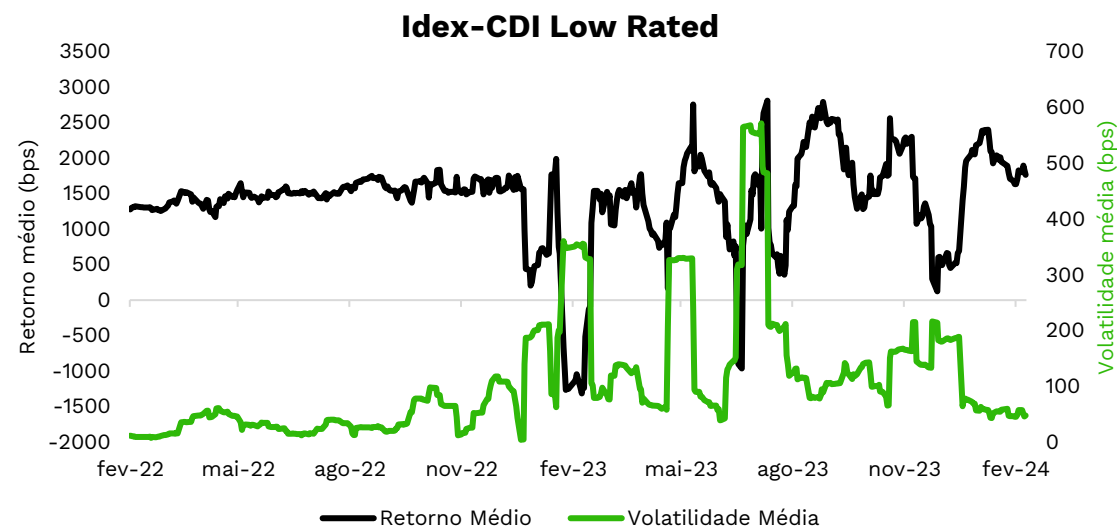
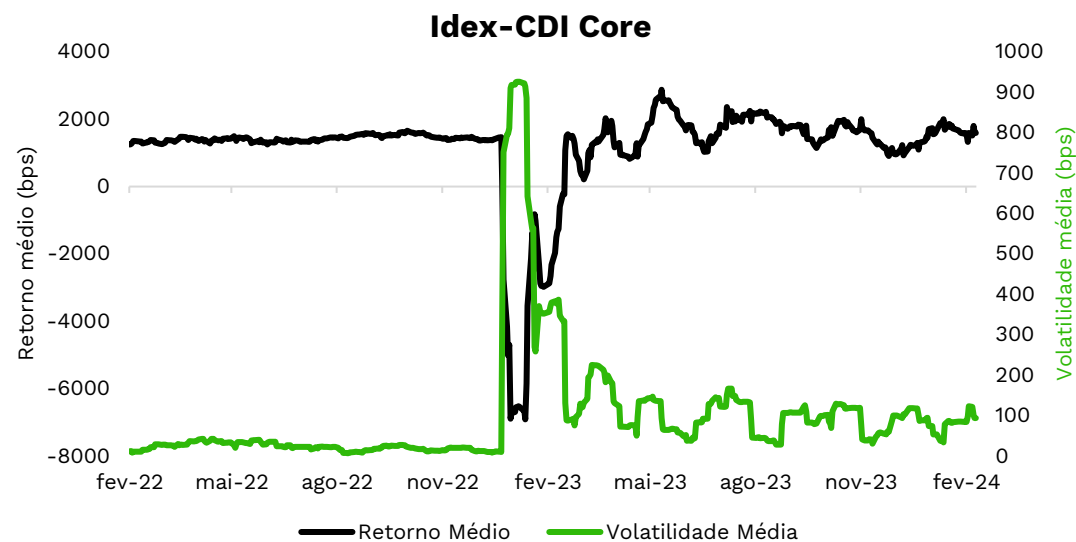
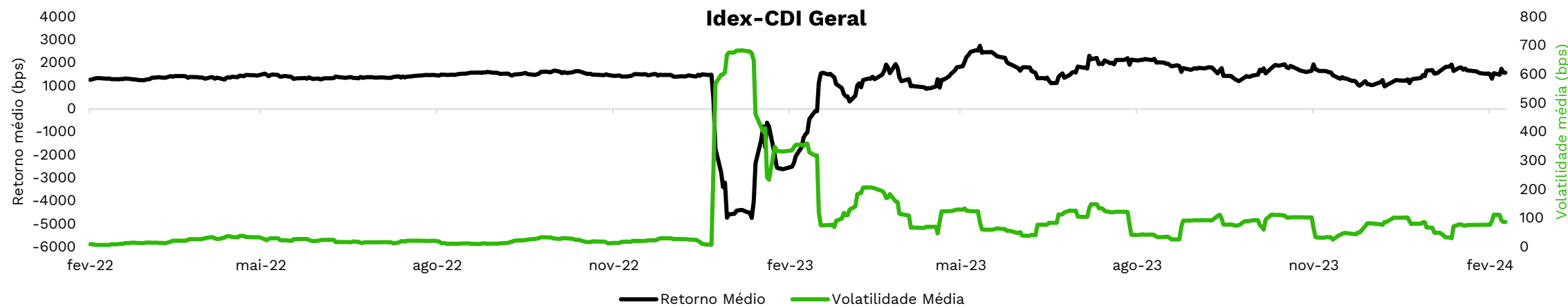
Rentabilidade do I dex-CDI Geral (12 meses)

Mês	%DI	DI+	CDI
2024/02	0,90%	1,20%	0,80%
2024/01	1,16%	1,61%	0,97%
2023/12	1,09%	0,72%	0,89%
2023/11	1,31%	1,29%	0,92%
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%
Total	15,72%	17,35%	12,73%

Idex-CDI JGP

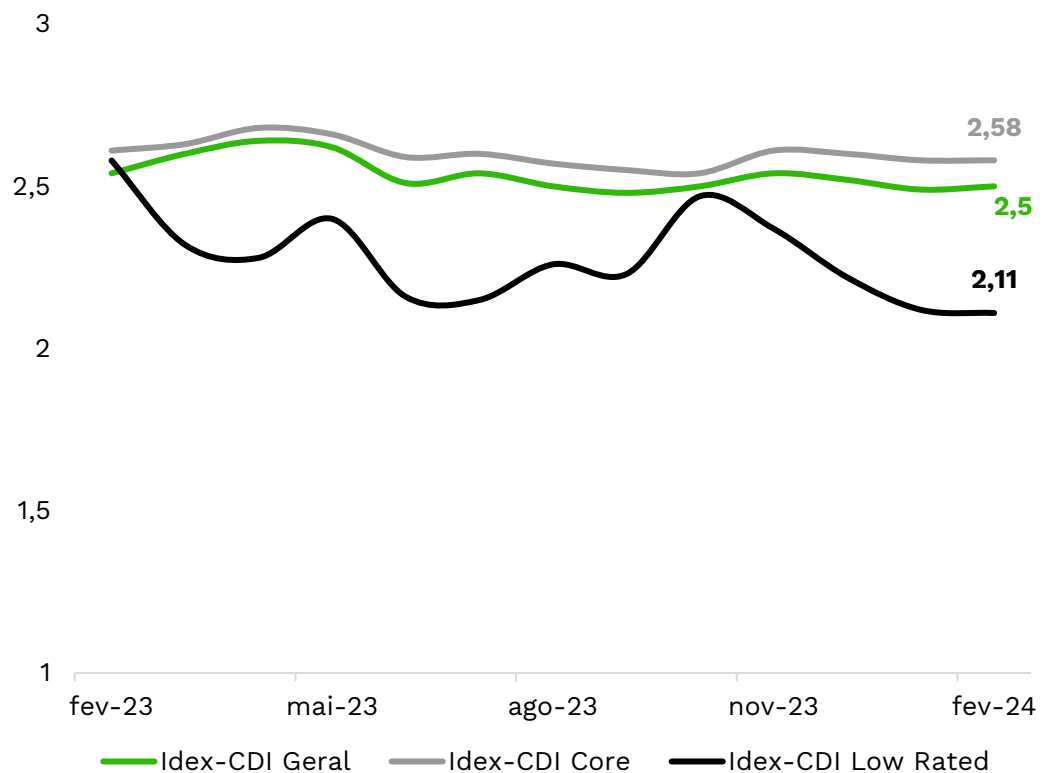
Gráficos e Tabelas

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

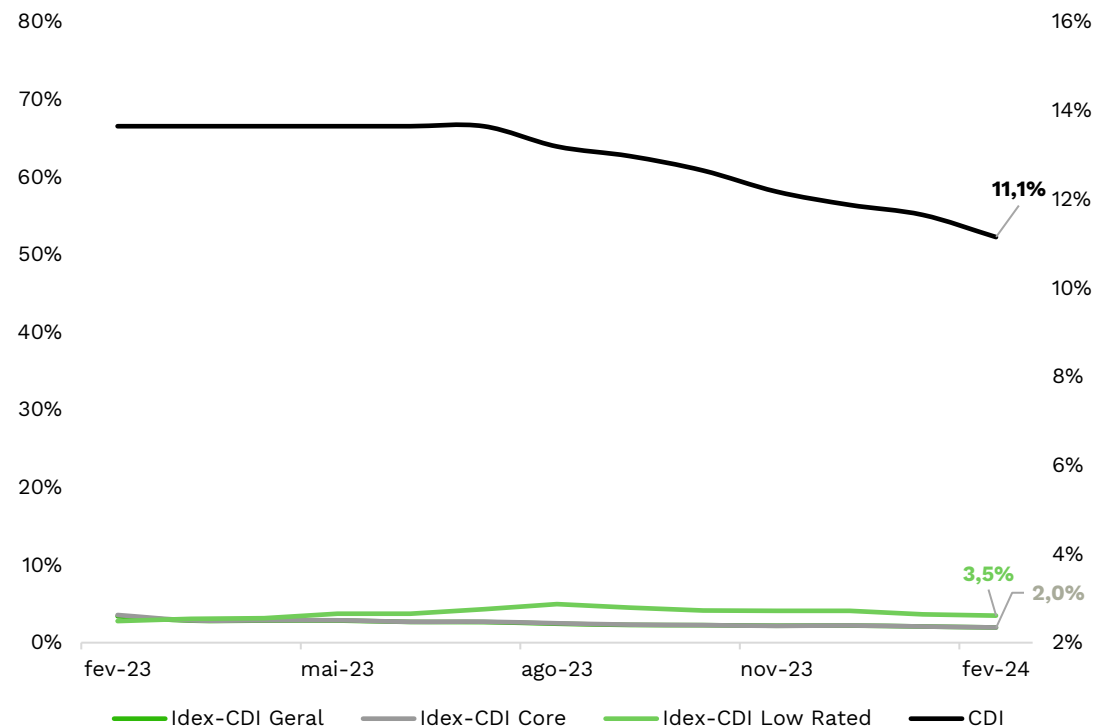


Duration e Spread

Duration to Maturity Ponderada (em anos)



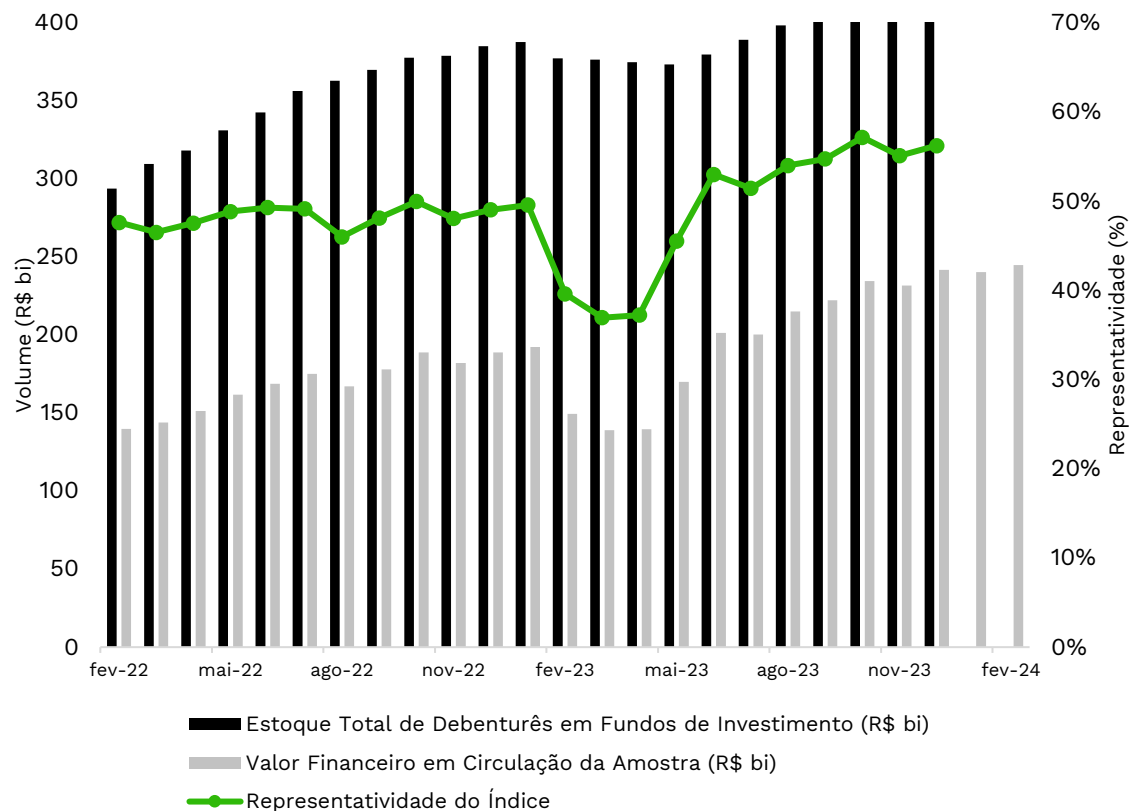
Evolução dos Spreads de Carregos Médios Ponderados (em CDI+)



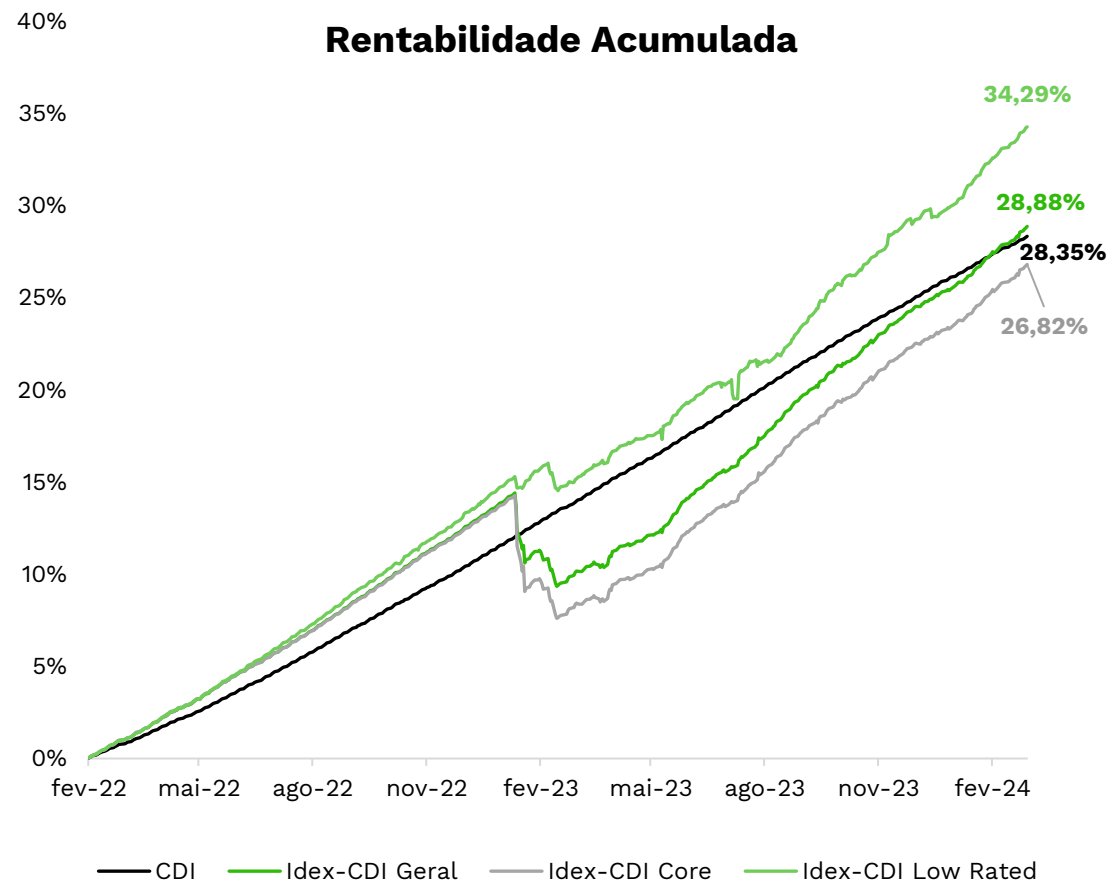
Fonte: JGP

I dex-CDI Geral

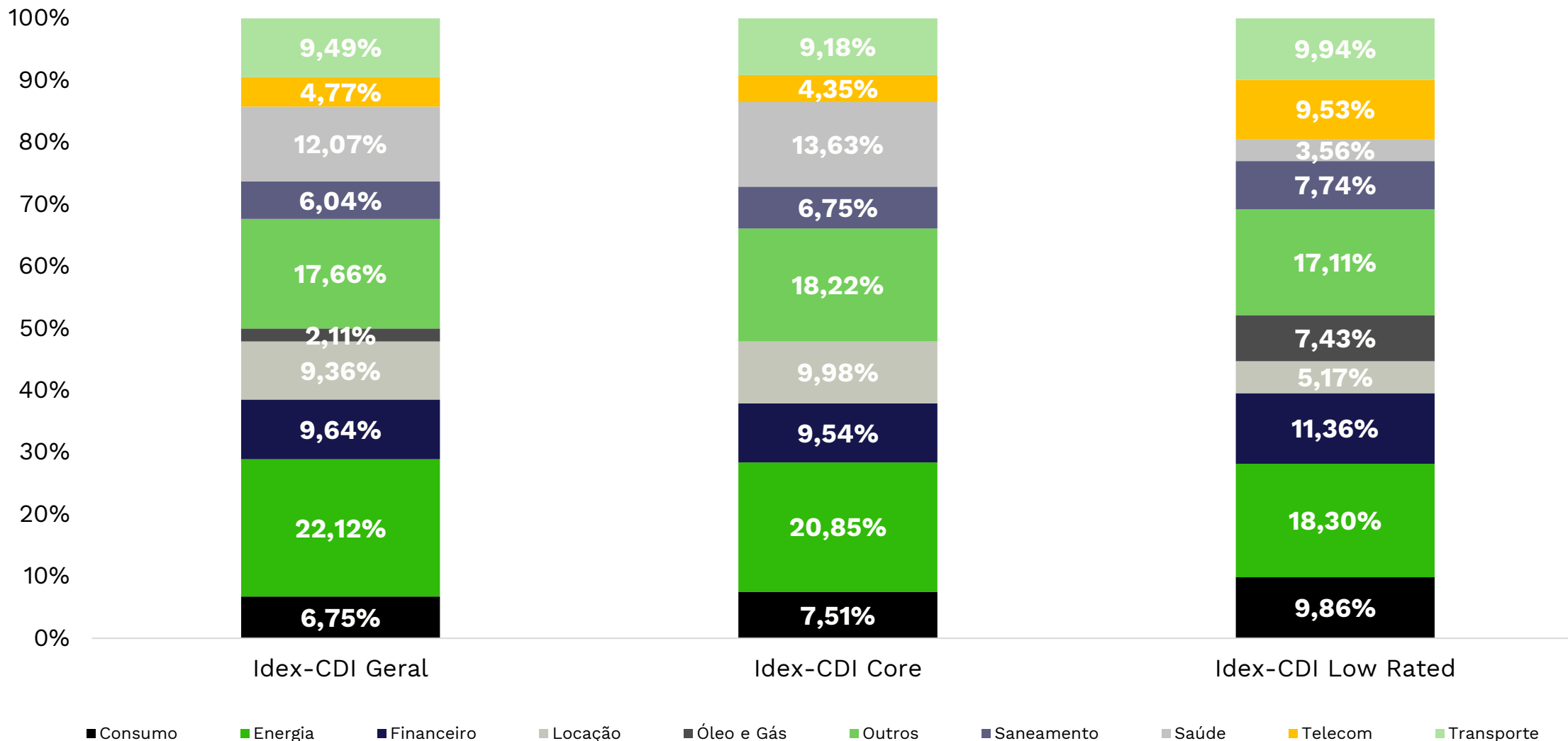
Representatividade do Índice



Rentabilidade Acumulada



Exposição por Setor (29/02/24)



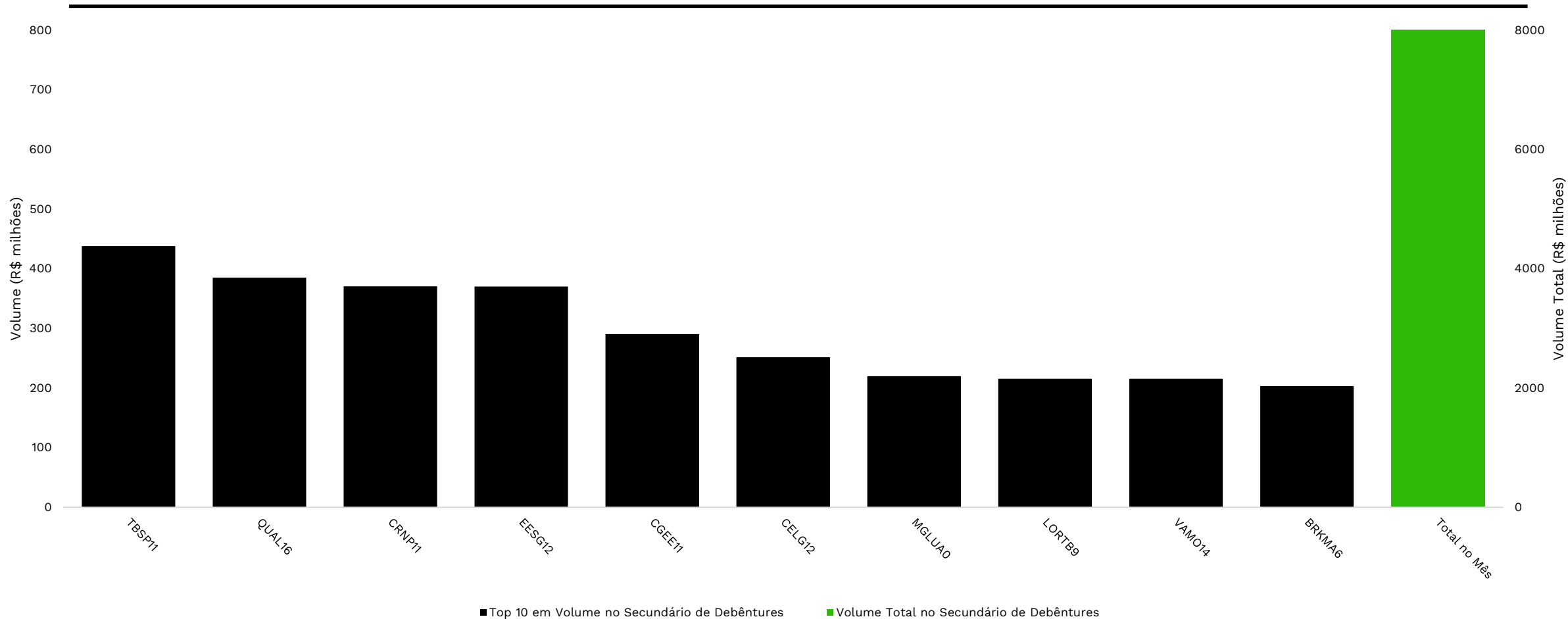
Fonte: JGP

Histórico de Performance

Ano		Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Acum Ano
2024	Idex-CDI Geral	1,55 %	1,17 %											2,82 %
	Idex-CDI Core	1,59 %	1,18 %											2,89 %
	Idex-CDI Low Rated	1,94 %	1,36 %											3,41 %
	CDI	0,97 %	0,80 %											1,82 %
2023	Idex-CDI Geral	-2,24 %	-1,22 %	1,17 %	0,77 %	1,79 %	1,27 %	1,64 %	1,89 %	1,41 %	1,28 %	1,29 %	0,78 %	10,18 %
	Idex-CDI Core	-3,49 %	-1,41 %	1,13 %	0,75 %	1,83 %	1,25 %	1,63 %	1,92 %	1,43 %	1,26 %	1,29 %	0,72 %	8,48 %
	Idex-CDI Low Rated	0,83 %	-0,61 %	1,47 %	0,73 %	1,48 %	0,84 %	1,06 %	1,58 %	1,89 %	1,31 %	1,38 %	0,59 %	13,28 %
	CDI	1,12 %	0,92 %	1,17 %	0,92 %	1,12 %	1,07 %	1,07 %	1,14 %	0,97 %	1,00 %	0,92 %	0,89 %	13,04 %
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 %

Fonte: JGP

Volume no Secundário das Debêntures da Amostra (01/02/24 a 29/02/24) 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
BRKMA8	Braskem	11,08%	1384,64%
BRKMA6	Braskem	9,67%	1207,89%
CBRDA8	Cbd	5,10%	637,00%
VCCS11	Vert Crediare	4,73%	591,49%
BKBR19	Bk Brasil	3,30%	412,12%
IDEX-CDI Geral		1,17%	145,81%

5 Melhores variações de carregos no período

Ativo	Empresa	Carrego	% DI
CBRDA8	Cbd	1,53%	191,41%
AERI12	Aeris	1,48%	185,19%
AERI11	Aeris	1,46%	182,59%
MGLUA0	Magazine Luiza S.A.	1,38%	172,97%
KRSA11	Kora Saude Participacoes S.A.	1,32%	164,86%
IDEX-CDI Geral		0,95%	118,85%

5 Melhores variações a mercado no período

Ativo	Empresa	MTM	% DI
BRKMA8	Braskem	9,82%	1227,31%
BRKMA6	Braskem	8,42%	1052,77%
VCCS11	Vert Crediare	3,75%	468,93%
CBRDA8	Cbd	3,51%	439,19%
BKBR19	Bk Brasil	2,16%	269,45%
IDEX-CDI Geral		0,21%	26,71%

5 Piores variações no período

Ativo	Empresa	Variação	% DI
DASAC5	Dasa	-1,27%	-158,94%
DASAC0	Dasa	-0,17%	-20,95%
DASAB4	Dasa	0,04%	5,47%
DASAA1	Dasa	0,37%	45,86%
AERI12	Aeris	0,40%	50,03%
IDEX-CDI Geral		1,17%	145,81%

5 Piores variações de carregos no período

Ativo	Empresa	Carrego	% DI
RRRP12	3R Petroleum	0,47%	125,22%
SBSPB3	Sabesp	0,83%	104,24%
OMGE11	Serena Geracao	0,84%	105,12%
FLRY15	Fleury	0,85%	105,73%
MULP16	Multipian	0,85%	106,00%
IDEX-CDI Geral		0,95%	118,85%

5 Piores variações a mercado no período

Ativo	Empresa	MTM	% DI
DASAC5	Dasa	-2,32%	-290,26%
DASAC0	Dasa	-1,23%	-153,28%
AERI12	Aeris	-1,07%	-133,31%
DASAB4	Dasa	-0,99%	-124,11%
DASAA1	Dasa	-0,68%	-84,95%
IDEX-CDI Geral		0,21%	26,71%

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