



Idex

Idex-Infra

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,

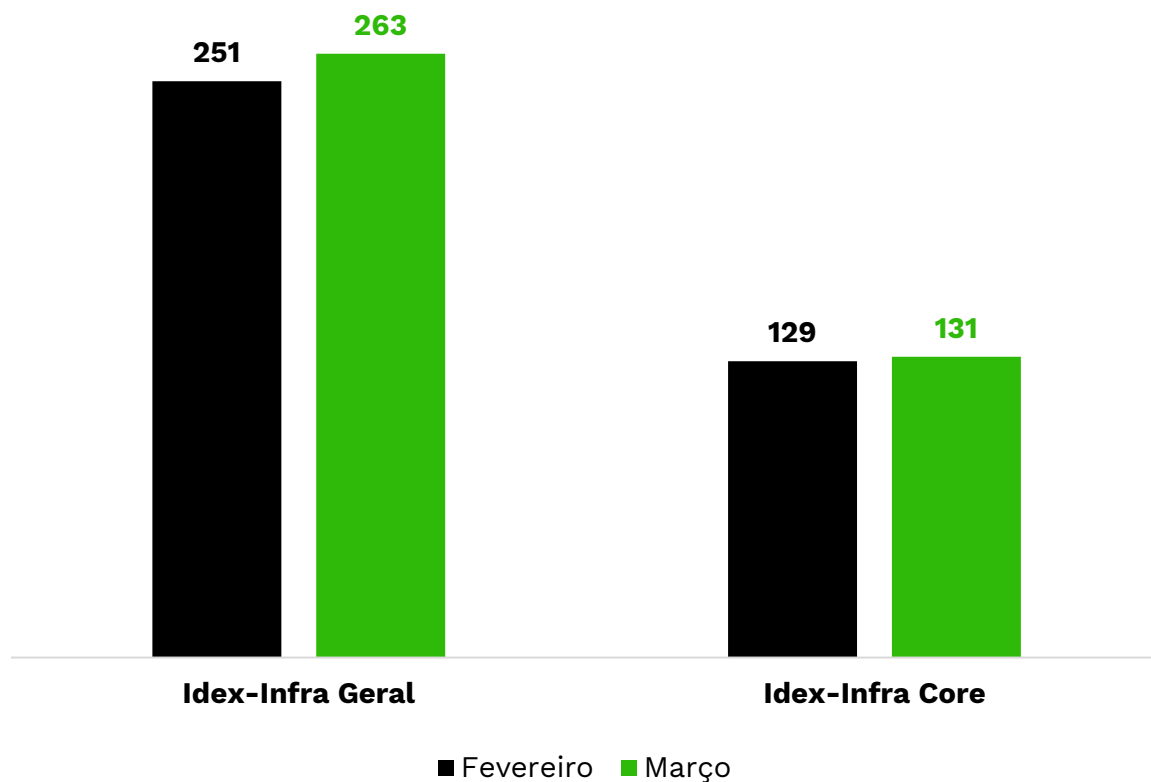
JGP

Idex-Infra JGP

Comentário Mensal — Fevereiro

Nova Amostra

Alterações nas Amostras



Alterações no Índice- Idex-Infra Geral (29-Fev — 01-Mar)

Ingressaram no Idex-Infra (17)		Saíram do Idex-Infra (5)
AEAB11	ERDVC3	CSNP12
ALGTA4	ITGT11	EGIEA0
CART12	PALFB3	ENGIB4
CASN23	PETR25	TAE26
CPFPA0	RUMOB5	TAE2C
CTNS14	SABP12	
EBAS13	TAES15	
EGIEA1	UNTE11	
ENGI28		

Destques de performance

Idex-Infra Geral

Maiores aberturas de spread (bps over B-ref)

Ativo	1-Feb-24	29-Feb-24	Dif
CSNP12	129,5	155,5	26
EGVG11	38,5	30,6	-8
RESA27	55,5	47,4	-8
EGIE39	37,1	27,9	-9
TAEEC2	40,9	31,6	-9

Maiores fechamentos de spread (bps over B-ref)

Ativo	1-Feb-24	29-Feb-24	Dif
VRDN12	248	159,2	-89
CEAR26	-40,7	-127,4	-87
CNRD11	311,7	233,1	-79
CRMG15	159,9	86	-74
BRKP28	187,1	117,4	-70

Idex-Infra Core

Maiores aberturas de spread (bps over B-ref)

Ativo	1-Feb-24	29-Feb-24	Dif
RESA27	55,5	47,4	-8
EGIE39	37,1	27,9	-9
TAEEC2	40,9	31,6	-9
RESA17	51,2	38,8	-12
ELPLA5	59,6	44,5	-15

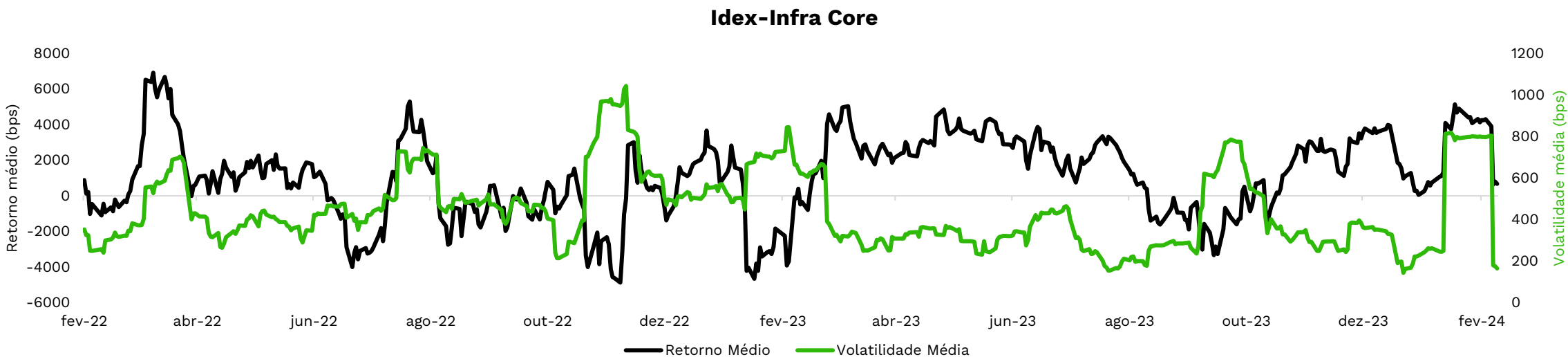
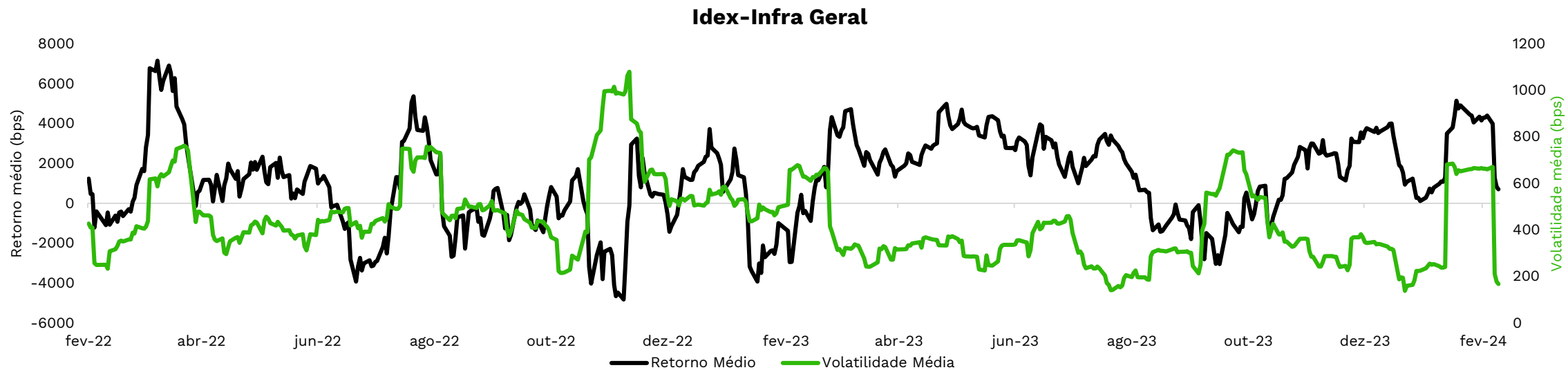
Maiores fechamentos de spread (bps over B-ref)

Ativo	1-Feb-24	29-Feb-24	Dif
CRMG15	159,9	86	-74
BRKP28	187,1	117,4	-70
ENAT11	260,2	192,6	-68
VBRR11	272	205,6	-66
CTEE1B	56,7	3,3	-53

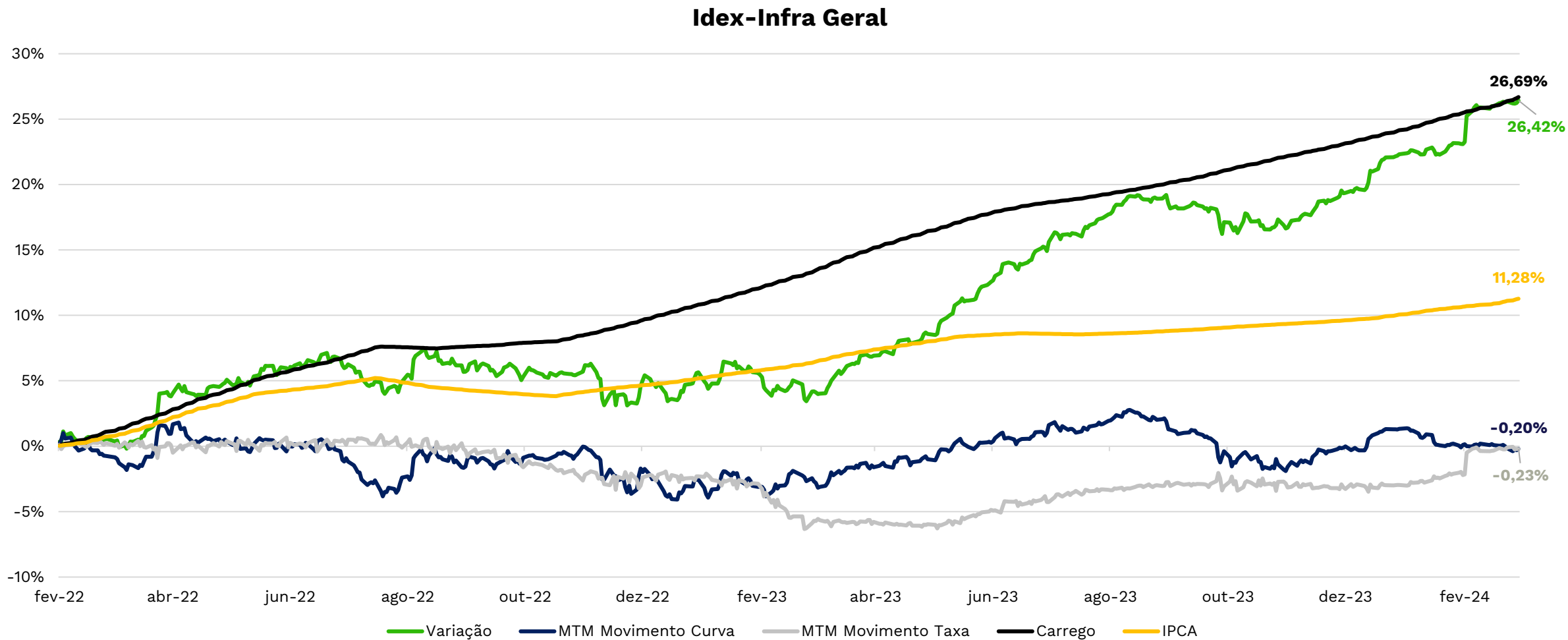
Idex- Infra JGP

Gráficos e Tabelas

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



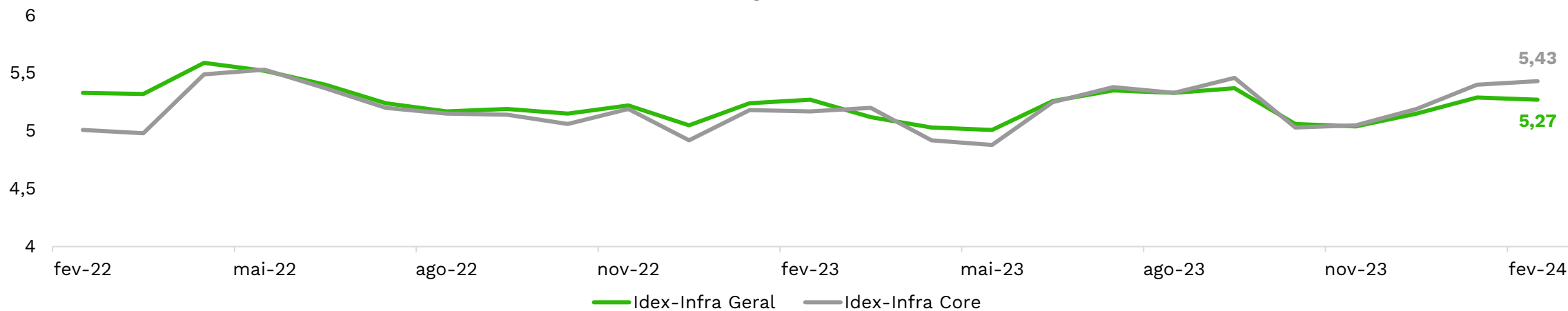
Rentabilidade Acumulada (2 anos)



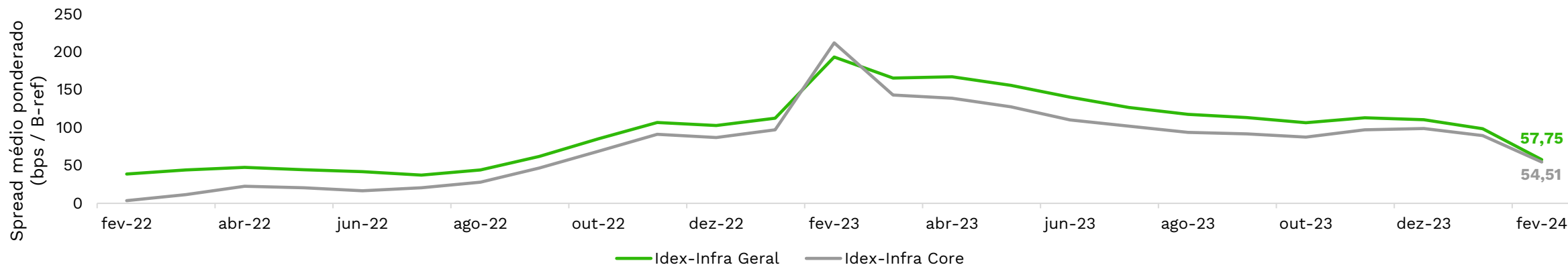
Fonte: JGP

Duration e Spread

Duration to Maturity Ponderada (em anos)

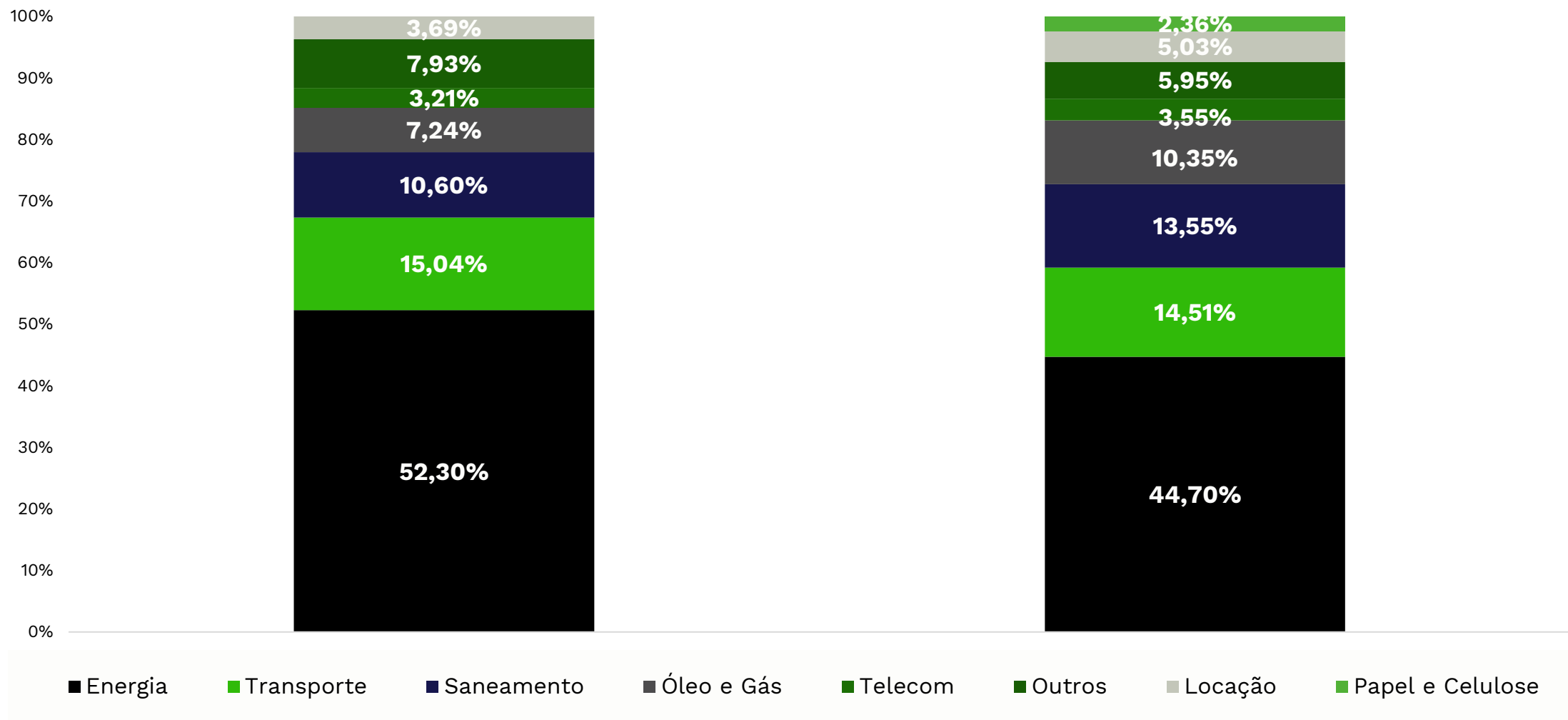


Evolução mensal dos spreads médios: Idex - Infra Geral e Idex - Infra Core



Fonte: JGP

Exposição por Setor (29/02/24)

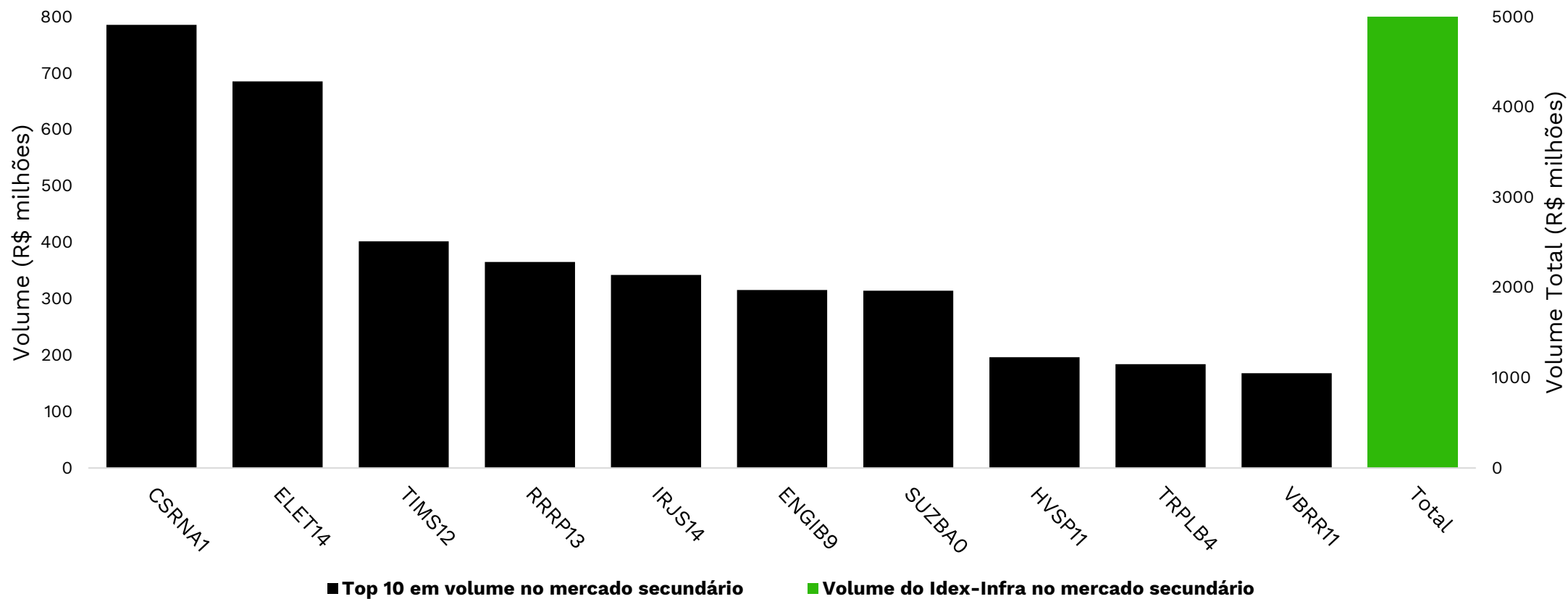


Fonte: JGP

Histórico de Performance

Ano		Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Acum Ano
2024	Idex-Infra Geral	0,63 %	2,70 %											3,35 %
	Idex-Infra Core	0,61 %	2,66 %											3,29%
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 (01/02/24 — 29/02/24) 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
PTAZ11	Parintins Amazonas	5,75%
BRKP28	Brk Ambiental	5,45%
CNRD11	Concessionaria Da Rodovia Ms	5,32%
COMR14	Comerc Participacoes	5,11%
VRDN12	Via Rondon	5,09%
IDEX-Infra Geral		2,72%

5 Melhores variações de carregos no período

Ativo	Empresa	Variação
CPTM15	Ligga Telecomunicacoes	1,28%
ANET11	Americanet	1,13%
ANET12	Americanet	1,12%
ANEM11	Anemus Wind Holding S.A.	1,11%
CNRD11	Concessionaria Da Rodovia Ms	1,11%
IDEX-Infra Geral		0,97%

5 Melhores variações a mercado no período

Ativo	Empresa	Variação
PTAZ11	Parintins Amazonas	4,73%
BRKP28	Brk Ambiental	4,38%
CNRD11	Concessionaria Da Rodovia Ms	4,17%
COMR14	Comerc Participacoes	4,06%
VRDN12	Via Rondon	3,99%
IDEX-Infra Geral		1,73%

5 Piores variações no período

Ativo	Empresa	Variação
CSNP12	Companhia Energética Sinop	0,62%
EGIE39	Engie Brasil	0,72%
ESULA1	Energisa Mato Grosso Do Sul	0,94%
EGIE17	Engie Brasil	0,96%
CPGT26	Copel Geracao E Transmissao	0,97%
IDEX-Infra Geral		2,72%

5 Piores variações de carregos no período

Ativo	Empresa	Variação
ENMI21	Companhia Energética Miranda	0,91%
ENJG21	Companhia Energética Jaguará	0,91%
FGEN13	Ferreira Gomes Energia	0,91%
EXTZ11	Sao Francisco	0,92%
ETEN31	Energisa Transmissao	0,92%
IDEX-Infra Geral		0,97%

5 Piores variações a mercado no período

Ativo	Empresa	Variação
CSNP12	Companhia Energética Sinop	-0,40%
EGIE39	Engie Brasil	-0,21%
ESULA1	Energisa Mato Grosso Do Sul	-0,00%
NRTB11	Norte Brasil Transmissora De Energia	0,01%
EGIE17	Engie Brasil	002%
IDEX-Infra Geral		1,73%

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