

Idex

Idex-CDI

Março 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,

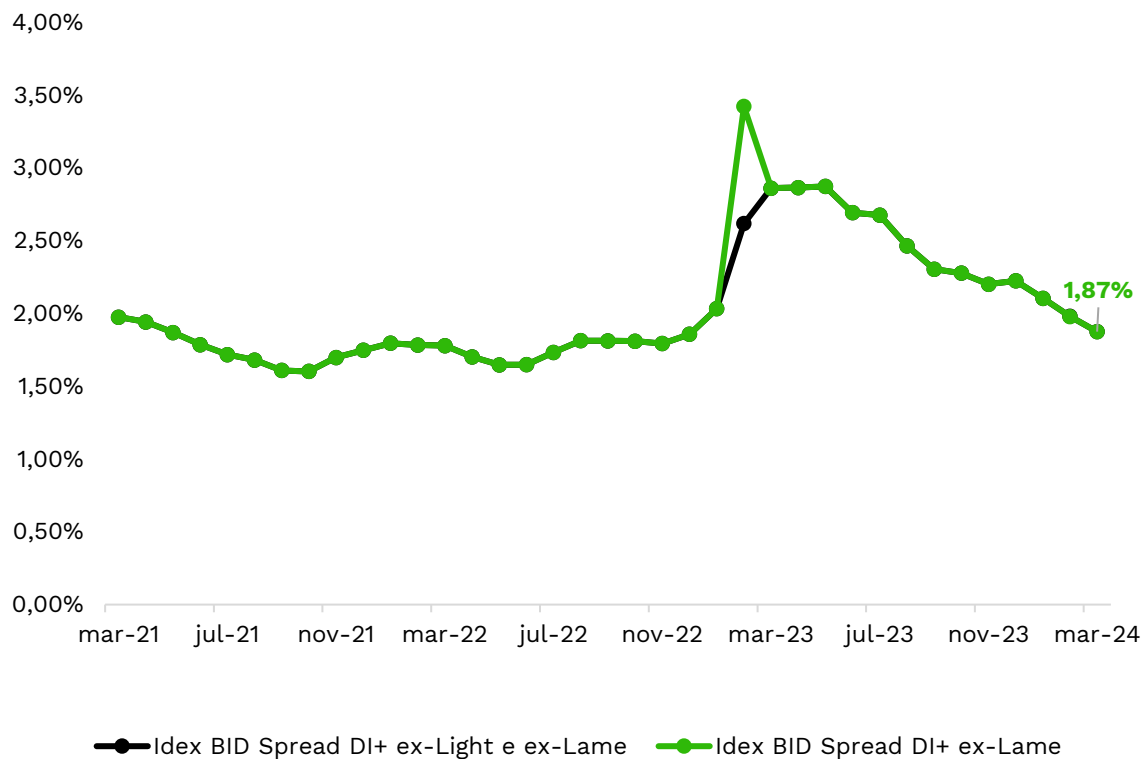
JGP

Idex-CDI JGP

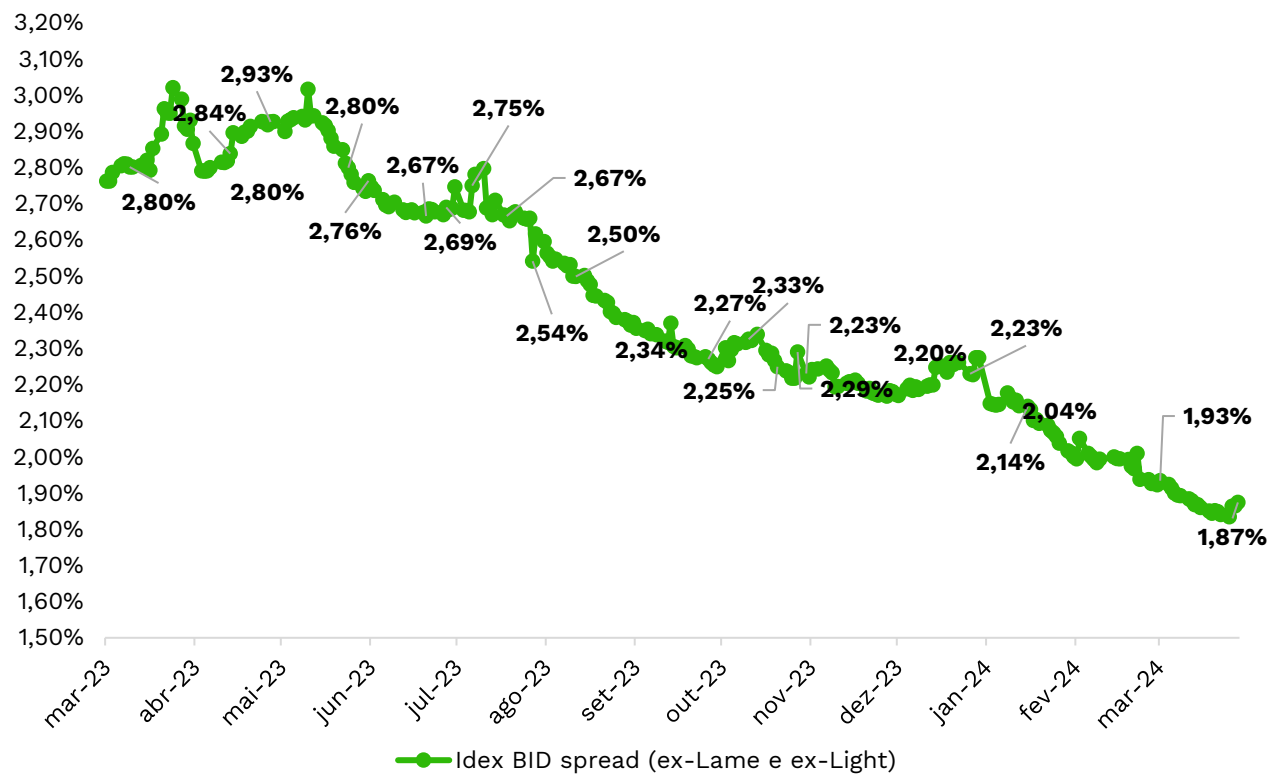
Comentário Mensal — Março

Comentário Mensal

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

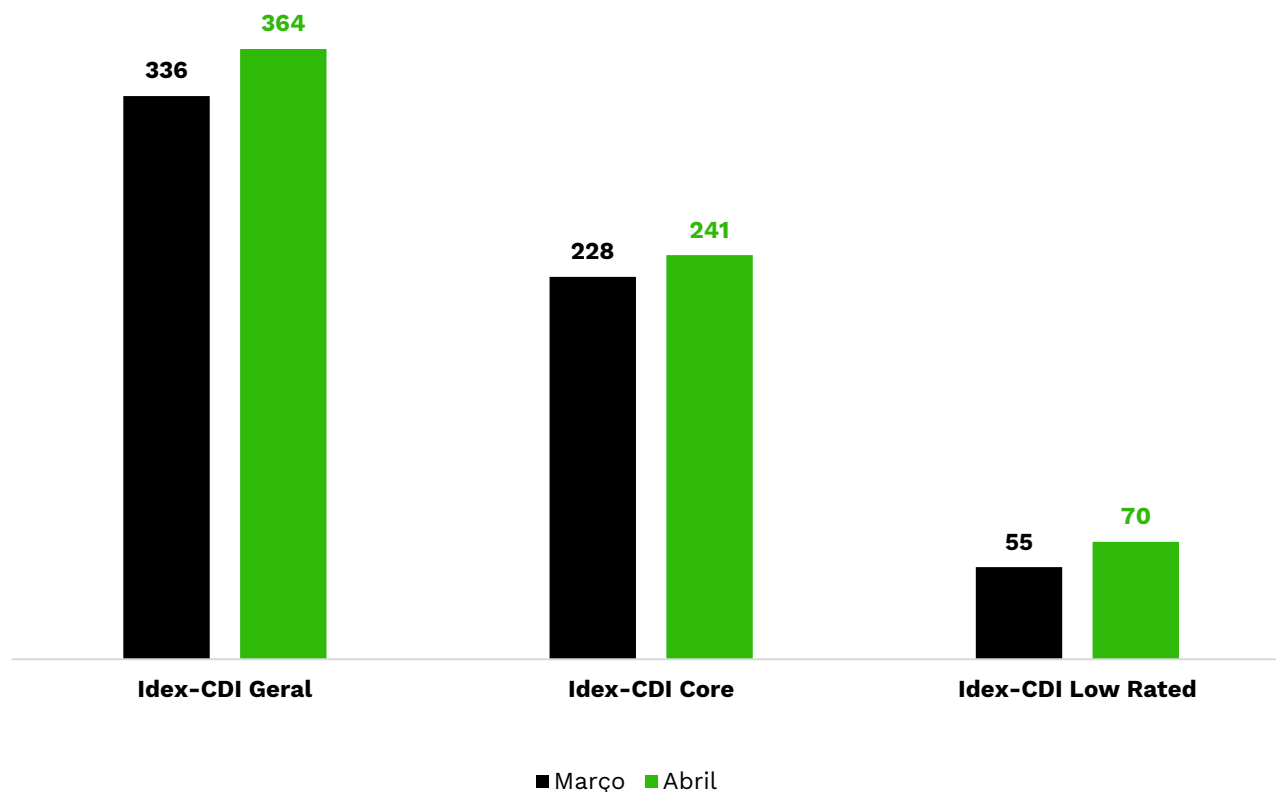


Evolução do *spread* diário do Idex-CDI (ex-Lame e Light)



Nova Amostra

Alterações na Amostra



Fonte: JGP

Alterações no Índice - Idex-CDI Geral (28-Mar — 1-Abr)

Ingressaram no Idex-CDI (38)			Saíram do Idex-CDI (10)
AEGP14	DIRR18	PCHS25	AGAU12
AESB11	ECOS15	PCHS27	BKBR18
ALUP17	ELFA12	PCHS35	BSA315
ASAI28	EMCC11	PCHS37	CAML10
CASN12	ENGIA3	PCHS45	GUAR24
CASN13	HYPEA7	PCHS47	LORTB3
CEAB22	IGSN14	RDORC1	MULP16
CEMTA1	LORTB1	SBFC11	OMGE11
CGOS14	MEAL14	TAEEB1	RIPR13
CPGT18	MRFGA0	TIETA0	SBSPB3
CRFB16	MRFGA1	VIAL19	
CRFB26	PCHS15	VLME12	
DASAA2	PCHS17		

Destques de performance

Maiores aberturas de spread %DI

Ativo	01-Mar	28-Mar	Dif
CEEBB2	111,00%	111,00%	0,00%
CEPE20	111,00%	111,00%	0,00%
PETR36	108,00%	108,00%	0,00%

Maiores fechamentos de spread %DI

Ativo	01-Mar	28-Mar	Dif
RADL14	109,50%	108,00%	-1,50%
UNDAC2	116,00%	115,00%	-1,00%
KLBNA2	110,50%	109,50%	-1,00%

Maiores aberturas de spread DI+

Ativo	01-Mar	28-Mar	Dif
AERI12	10,50%	16,00%	5,50%
CMPH14	2,70%	6,00%	3,30%
AERI11	9,30%	11,00%	1,70%

Maiores fechamentos de spread DI+

Ativo	01-Mar	28-Mar	Dif
CBRDB8	11,00%	6,35%	-4,65%
CBRDA8	8,00%	6,20%	-1,80%
ENAT21	4,35%	2,65%	-1,70%

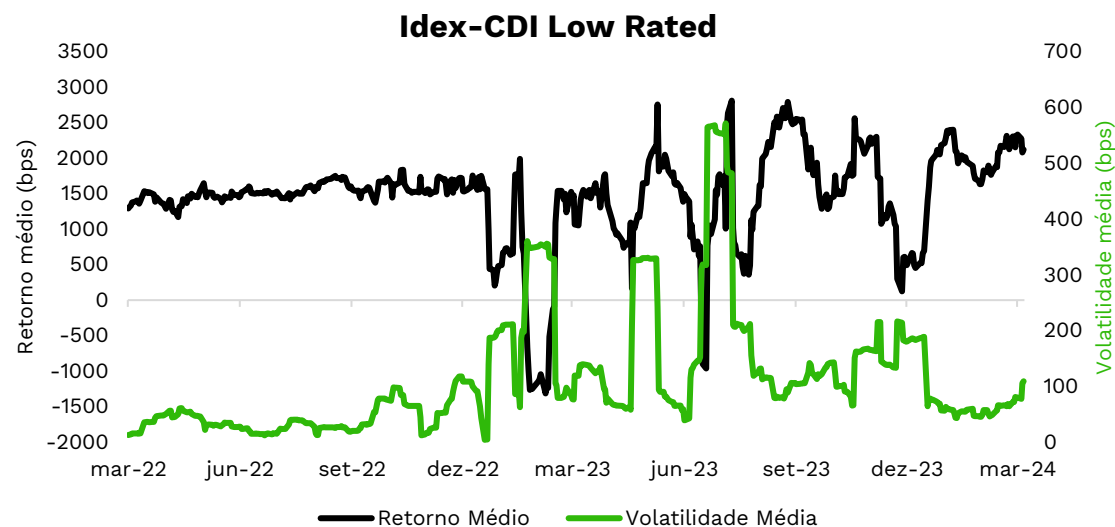
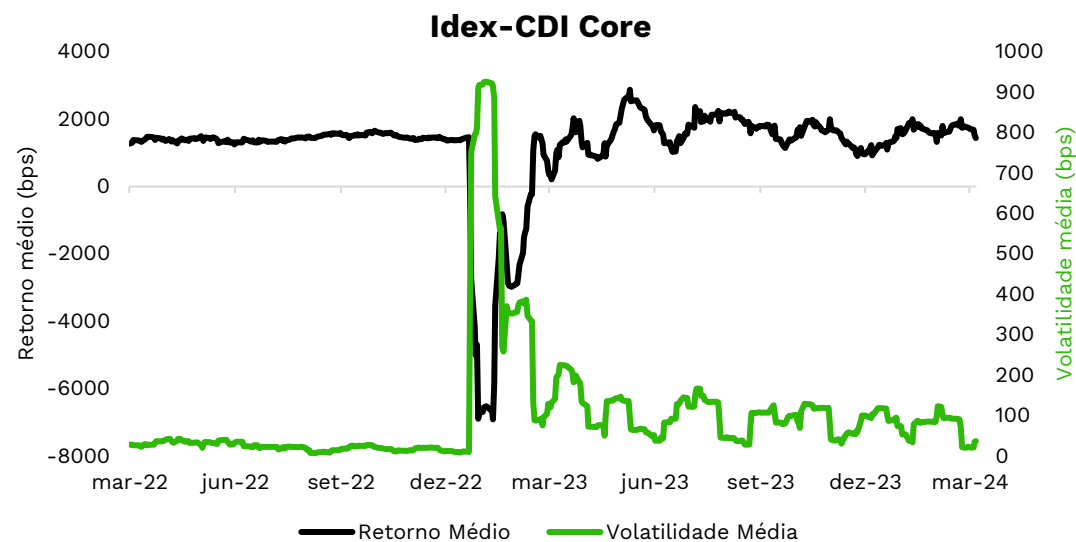
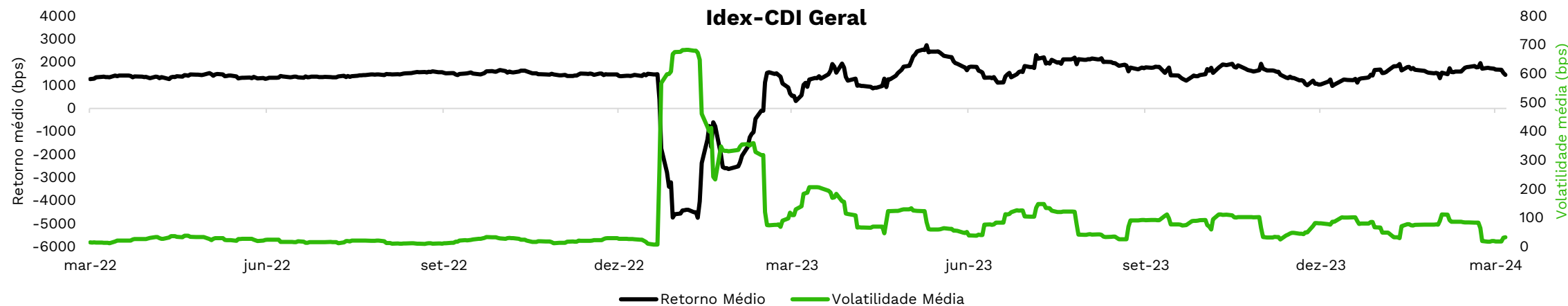
Rentabilidade do Idex-CDI Geral (12 meses)

Mês	%DI	DI+	CDI
2024/03	1,07%	1,22%	0,83%
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%
Total	15,58%	17,44%	12,35%

Idex-CDI JGP

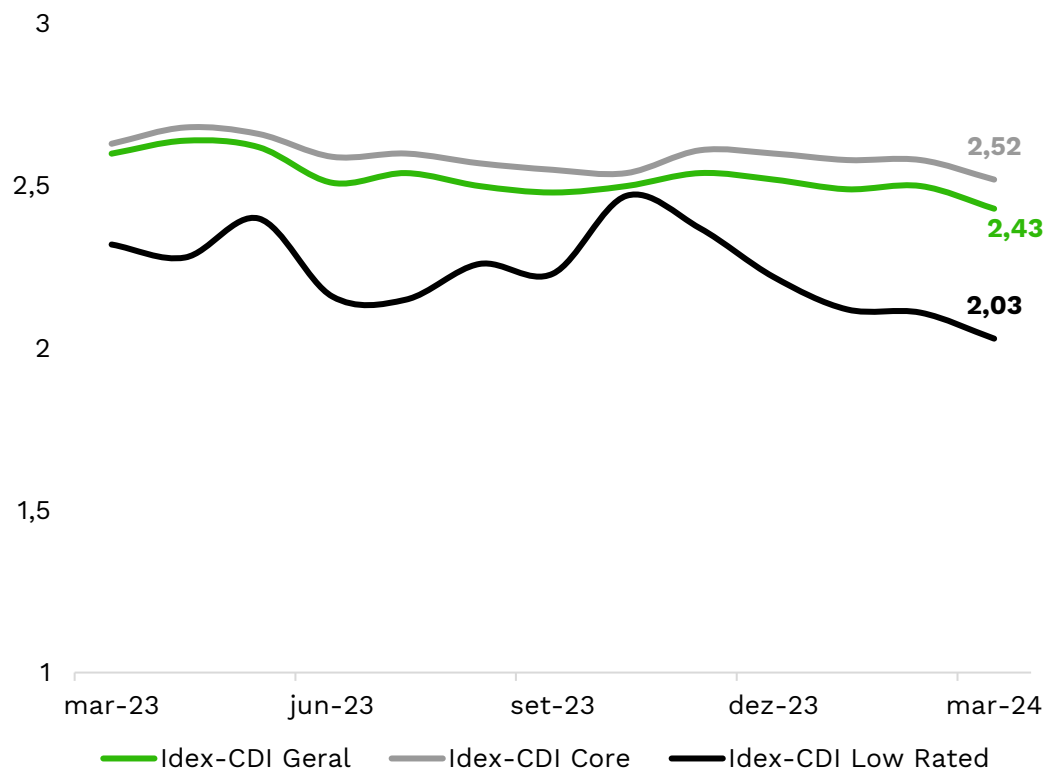
Gráficos e Tabelas

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

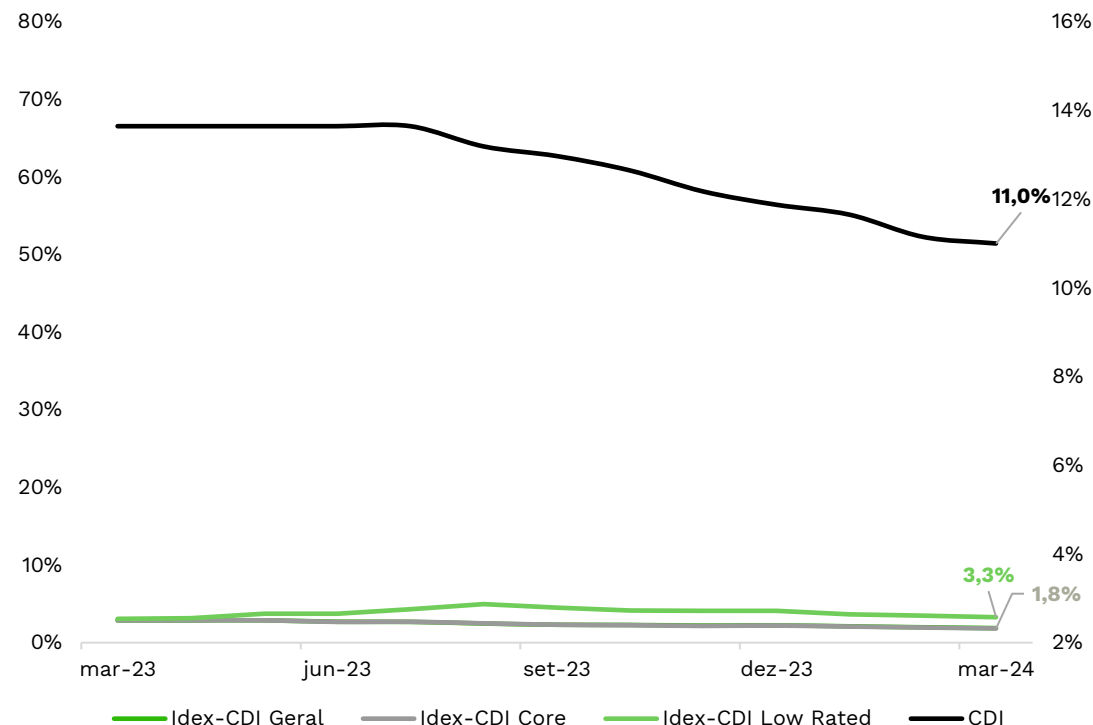


Duration e Spread

Duration to Maturity Ponderada (em anos)



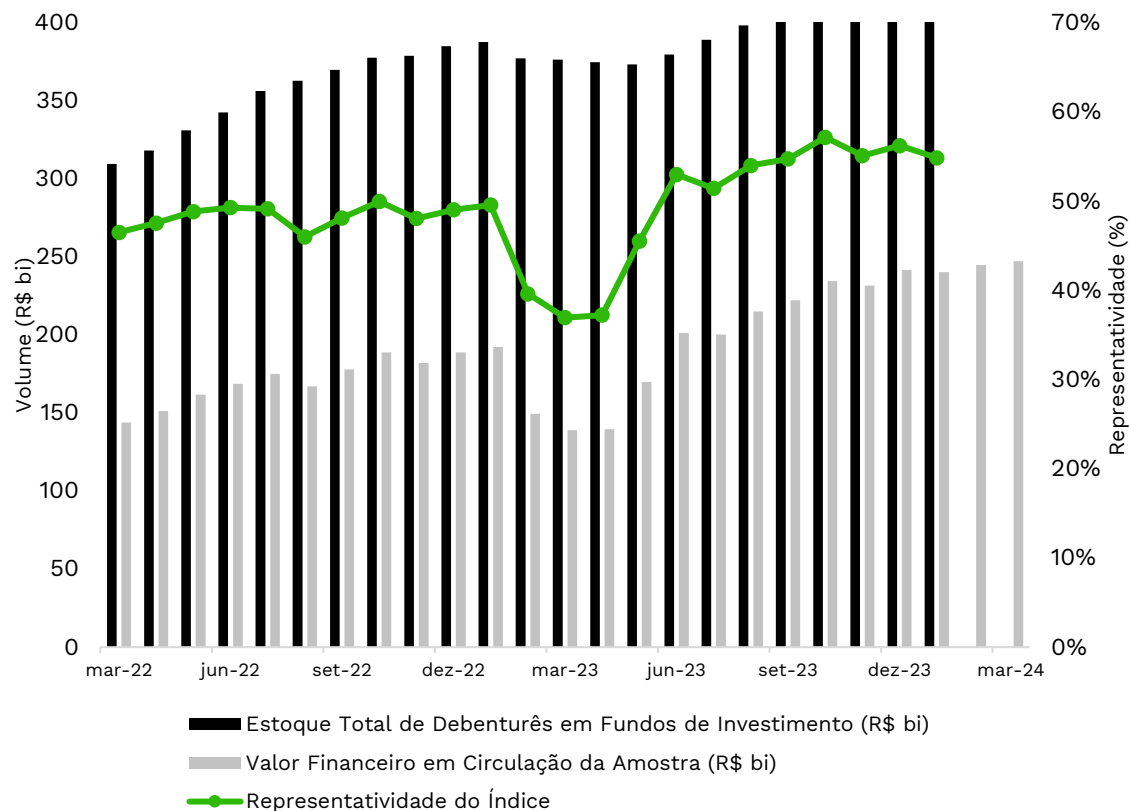
Evolução dos Spreads de Carregos Médios Ponderados (em CDI+)



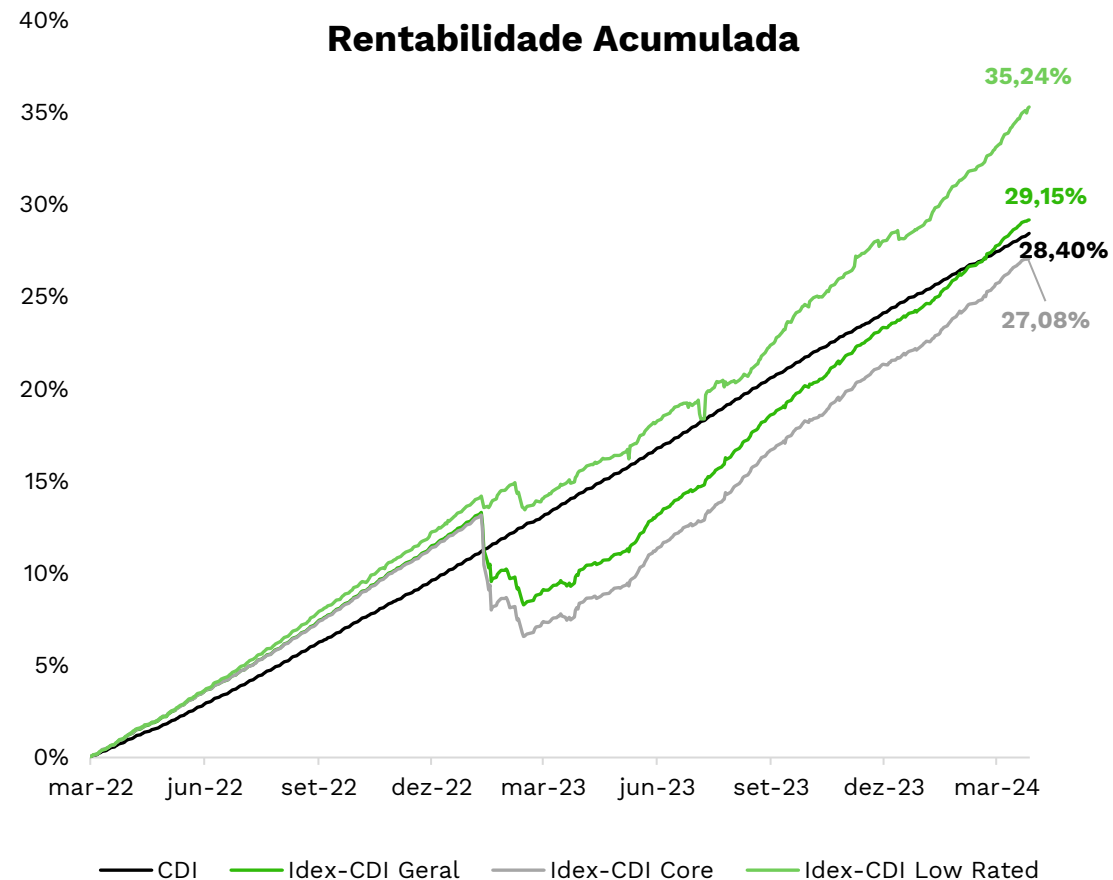
Fonte: JGP

Idex-CDI Geral

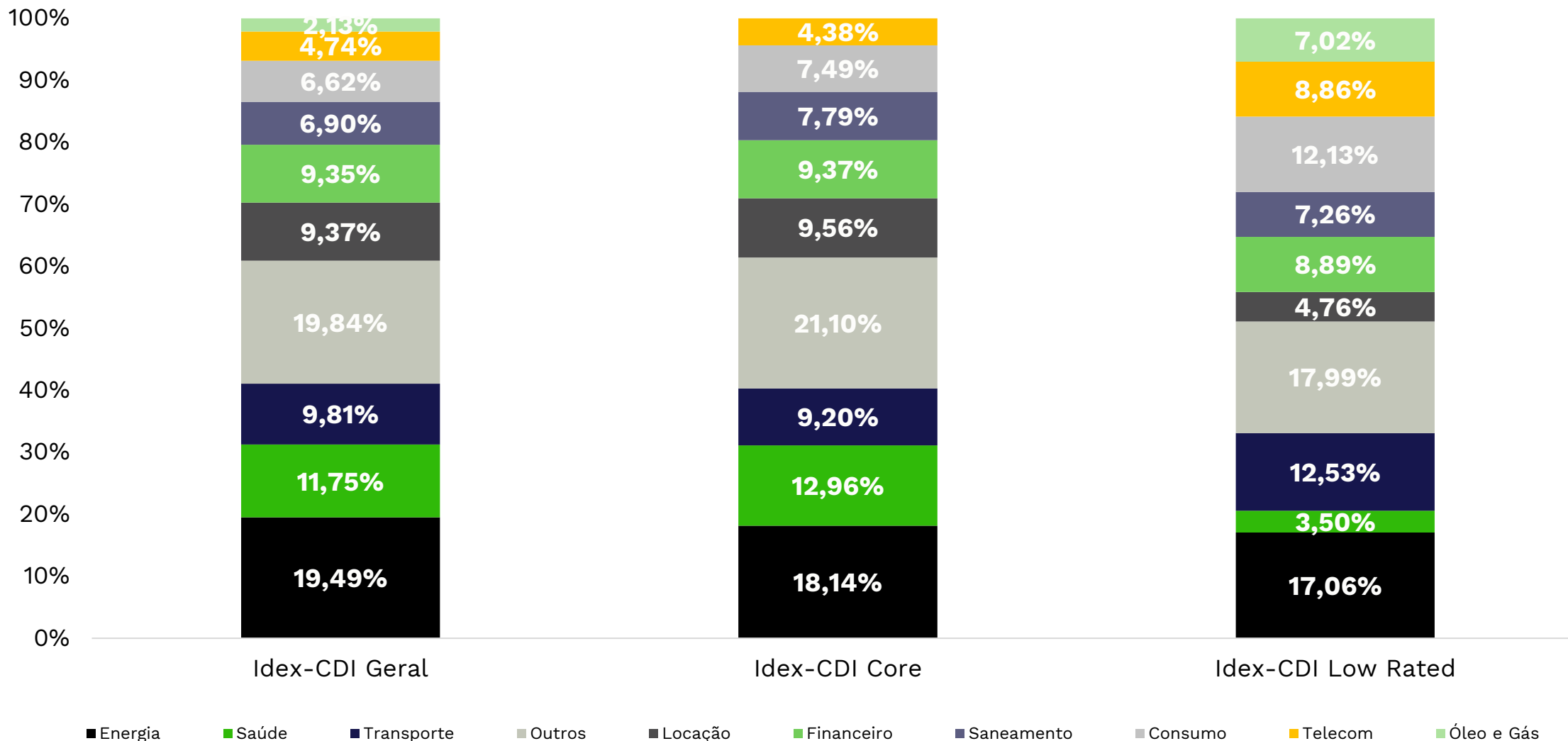
Representatividade do Índice



Rentabilidade Acumulada



Exposição por Setor (28/03/24)

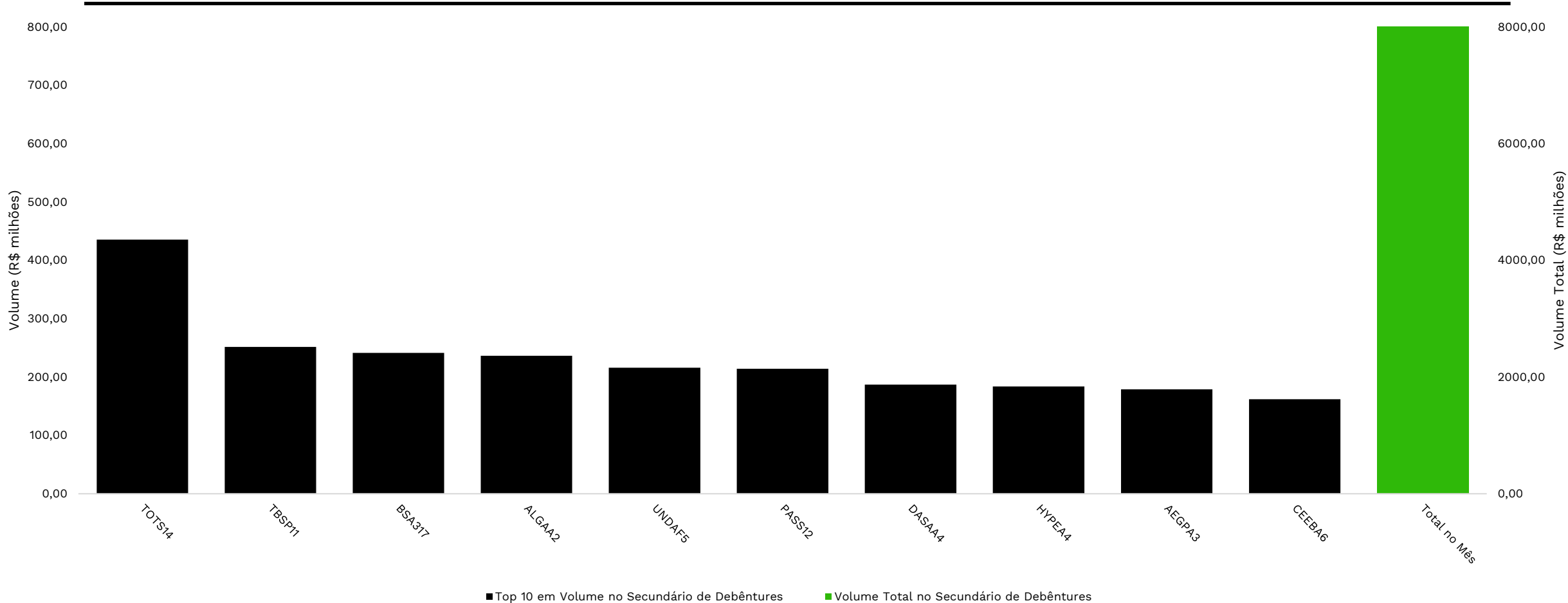


Fonte: JGP

Histórico de Performance

Ano		Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Acum Ano
2024	Iindex-CDI Geral	1,55 %	1,17 %	1,21 %										3,93 %
	Iindex-CDI Core	1,59 %	1,18 %	1,21 %										4,04 %
	Iindex-CDI Low Rated	1,94 %	1,36 %	1,74 %										5,13 %
	CDI	0,97 %	0,80 %	0,83 %										2,62 %
2023	Iindex-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% %
	Iindex-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 %
	Iindex-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	Iindex-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 %
	Iindex-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 %
	Iindex-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 %

Volume no Secundário das Debêntures da Amostra (01/03/24 a 28/03/24) em R\$ milhões



Fonte: JGP

Idex-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
CBRDB8	Cbd	14,60%	1754,99%
ENAT21	Enauta Participacoes S.A.	5,55%	666,82%
BRKPA1	Brk Ambiental	4,05%	486,51%
CBRDA8	Cbd	3,90%	469,11%
BRKPA0	Brk Ambiental	3,83%	460,18%
IDEX-CDI Geral		1,21%	145,40%

5 Melhores variações de carregos no período

Ativo	Empresa	Carrego	% DI
AERI12	Aeris	1,84%	221,84%
AERI11	Aeris	1,61%	193,79%
CBRDB8	Cbd	1,50%	179,94%
MGLUA0	Magazine Luiza S.A.	1,41%	170,04%
HSPA12	Hospital Anchieta S.A.	1,39%	166,71%
IDEX-CDI Geral		0,98%	118,30%

5 Melhores variações a mercado no período

Ativo	Empresa	MTM	% DI
CBRDB8	Cbd	12,92%	1553,02%
ENAT21	Enauta Participacoes S.A.	4,37%	525,23%
BRKPA1	Brk Ambiental	2,92%	350,61%
BRKPA0	Brk Ambiental	2,71%	326,26%
CBRDA8	Cbd	2,51%	301,43%
IDEX-CDI Geral		0,22%	26,84%

5 Piores variações no período

Ativo	Empresa	Variação	% DI
CMPH14	Viveo	-5,84%	-701,60%
AERI12	Aeris	-5,45%	-654,85%
VCCS11	Vert Crediare	-1,48%	-177,80%
AERI11	Aeris	-0,28%	-33,75%
MOVI17	Movida	0,00%	-0,50%
IDEX-CDI Geral		1,21%	145,40%

5 Piores variações de carregos no período

Ativo	Empresa	Carrego	% DI
SBSPB3	Sabesp	0,87%	104,28%
OMGE11	Serena Geracao	0,87%	104,28%
FLRY15	Fleury	0,88%	105,47%
MULP16	Multiplan	0,88%	105,48%
IGTA17	Iguatemi	0,88%	105,68%
IDEX-CDI Geral		0,98%	118,30%

5 Piores variações a mercado no período

Ativo	Empresa	MTM	% DI
AERI12	Aeris	-7,17%	-861,90%
CMPH14	Viveo	-6,85%	-823,23%
VCCS11	Vert Crediare	-2,42%	-291,00%
AERI11	Aeris	-1,86%	-224,11%
MOVI17	Movida	-1,04%	-124,54%
IDEX-CDI Geral		0,22%	26,84%

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