



Idex

Idex-Infra

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,

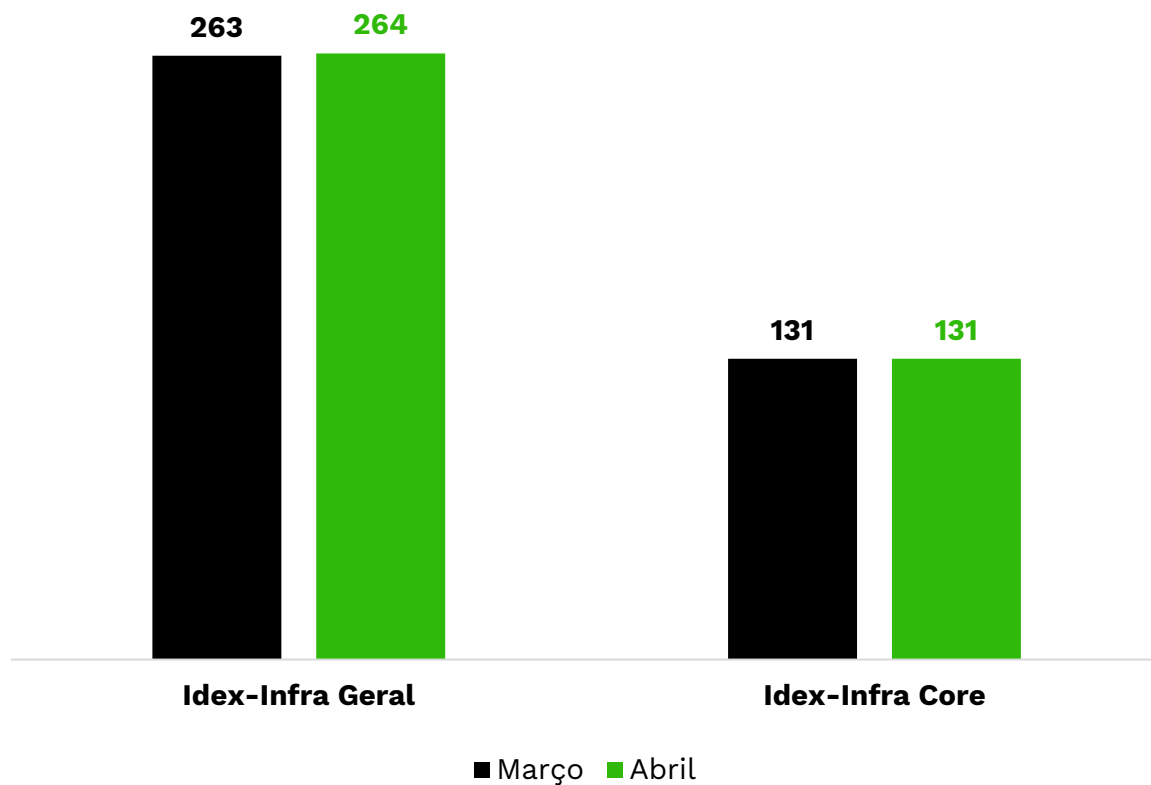
JGP

Idex-Infra JGP

Comentário Mensal — Março

Nova Amostra

Alterações nas Amostras



Alterações no Índice- Idex-Infra Geral (28-Mar — 01-Abr)

Ingressaram no Idex-Infra (4)	Saíram do Idex-Infra (3)
AESLA5	GASP16
CEEBB7	SBSPC6
CEPEB3	TAE17
CPFPA5	

Destques de performance

Idex-Infra Geral

Maiores aberturas de spread (bps over B-ref)

Ativo	1-Mar-24	28-Mar-24	Dif
PETR25	-128,4	-80,3	48
JALL13	57,6	80,9	23
ANEM11	236,9	259,6	23
ENJG21	-42,8	-23,1	20
RESA14	3,3	22,4	19

Maiores fechamentos de spread (bps over B-ref)

Ativo	1-Mar-24	28-Mar-24	Dif
CNRD11	231,5	135,7	-96
NRTB11	49,2	-27,4	-77
ENGI28	-29,3	-93,8	-64
ENAT11	189,5	127,5	-62
CAJS11	87,7	29,5	-58

Idex-Infra Core

Maiores aberturas de spread (bps over B-ref)

Ativo	1-Mar-24	28-Mar-24	Dif
PETR25	-128,4	-80,3	48
JALL13	57,6	80,9	23
RESA14	3,3	22,4	19
CTEE1B	0,8	19,7	19
CAEC21	88,1	104,8	17

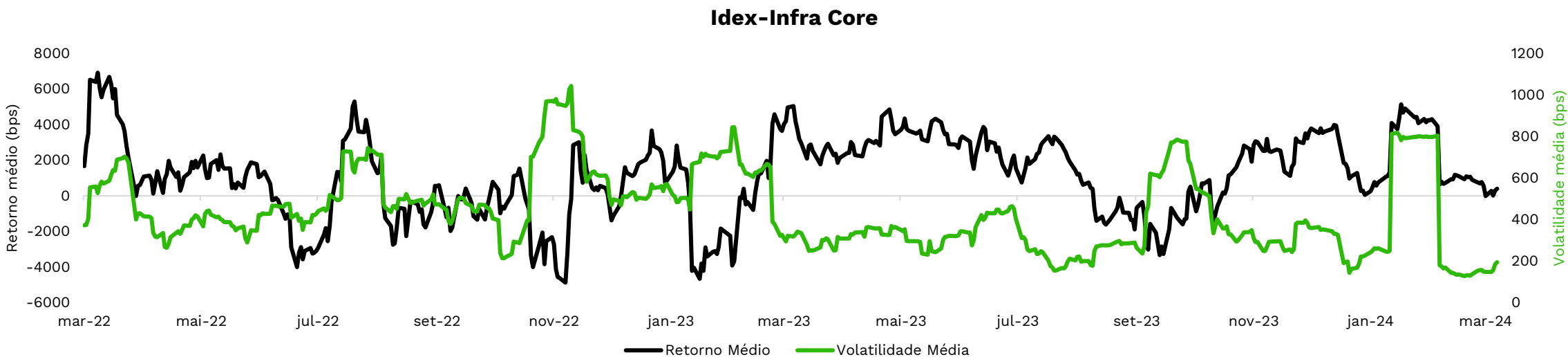
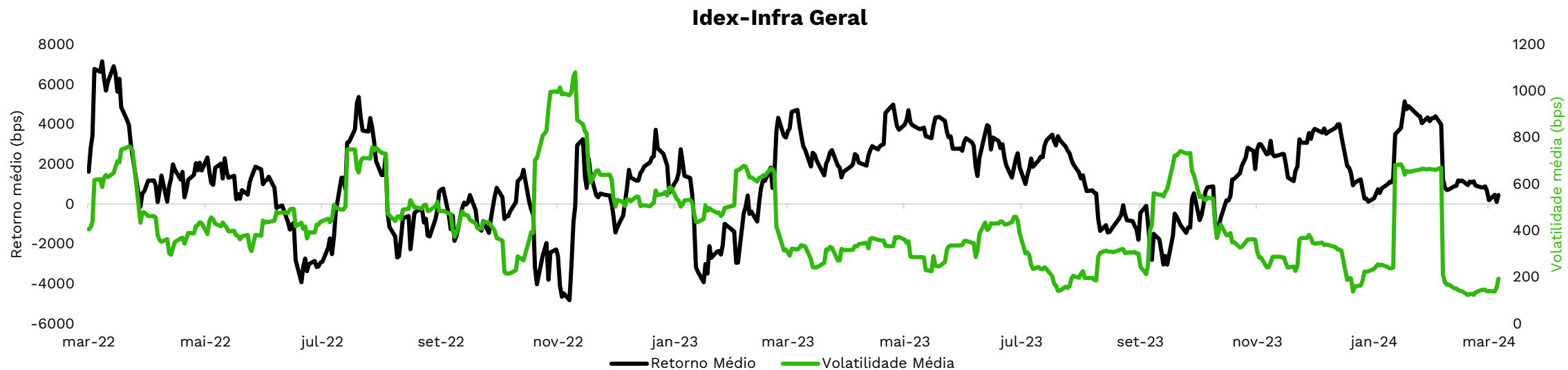
Maiores fechamentos de spread (bps over B-ref)

Ativo	1-Mar-24	28-Mar-24	Dif
ENAT11	189,5	127,5	-62
SAPRB3	64,6	9,5	-55
APRB18	84,8	48,9	-36
RSAN44	72,8	37,3	-36
SBSPB6	18	-11,3	-29

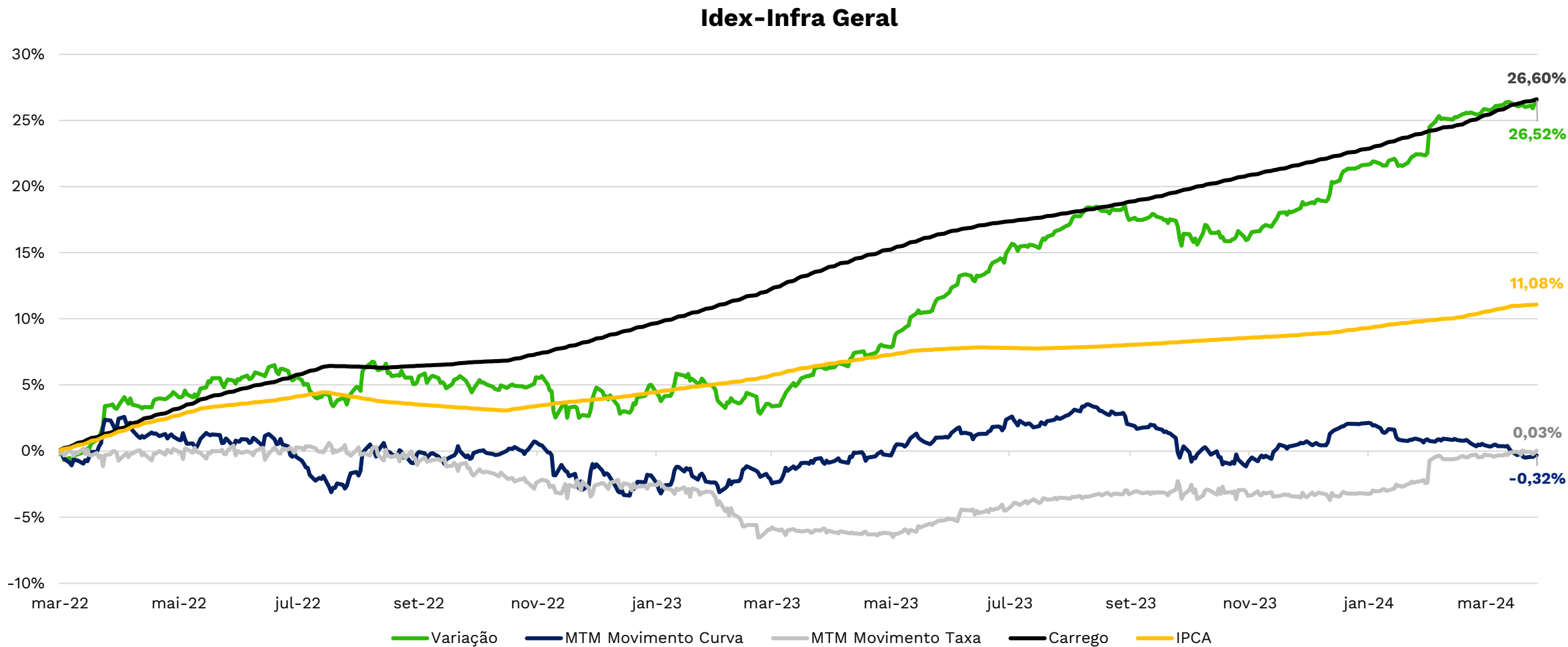
Idex- Infra JGP

Gráficos e Tabelas

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



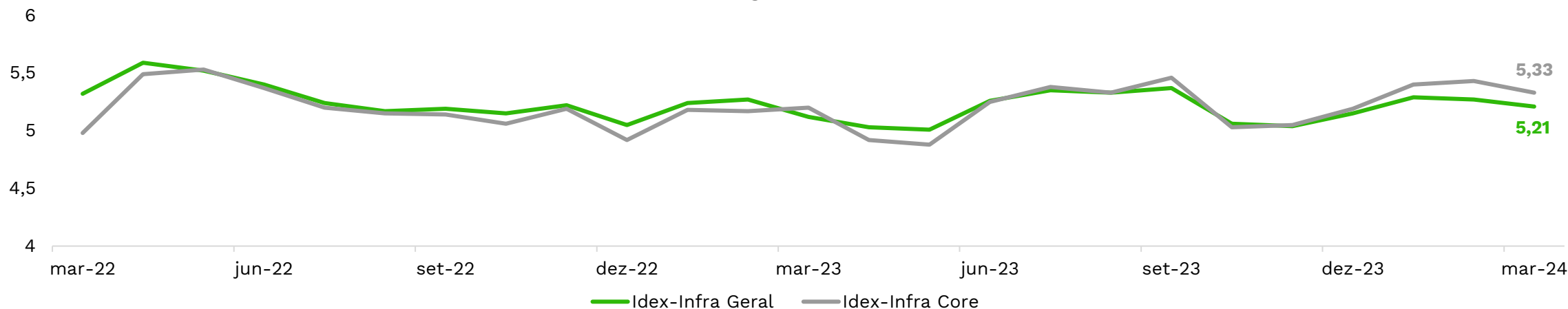
Rentabilidade Acumulada (2 anos)



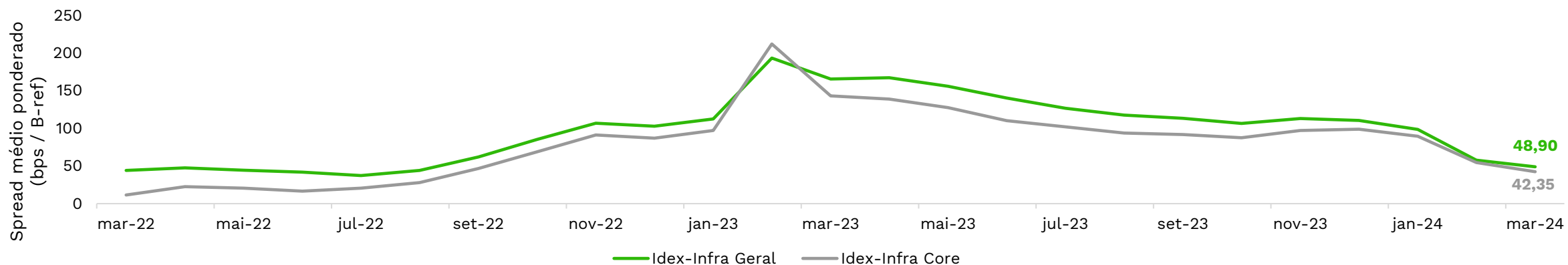
Fonte: JGP

Duration e Spread

Duration to Maturity Ponderada (em anos)

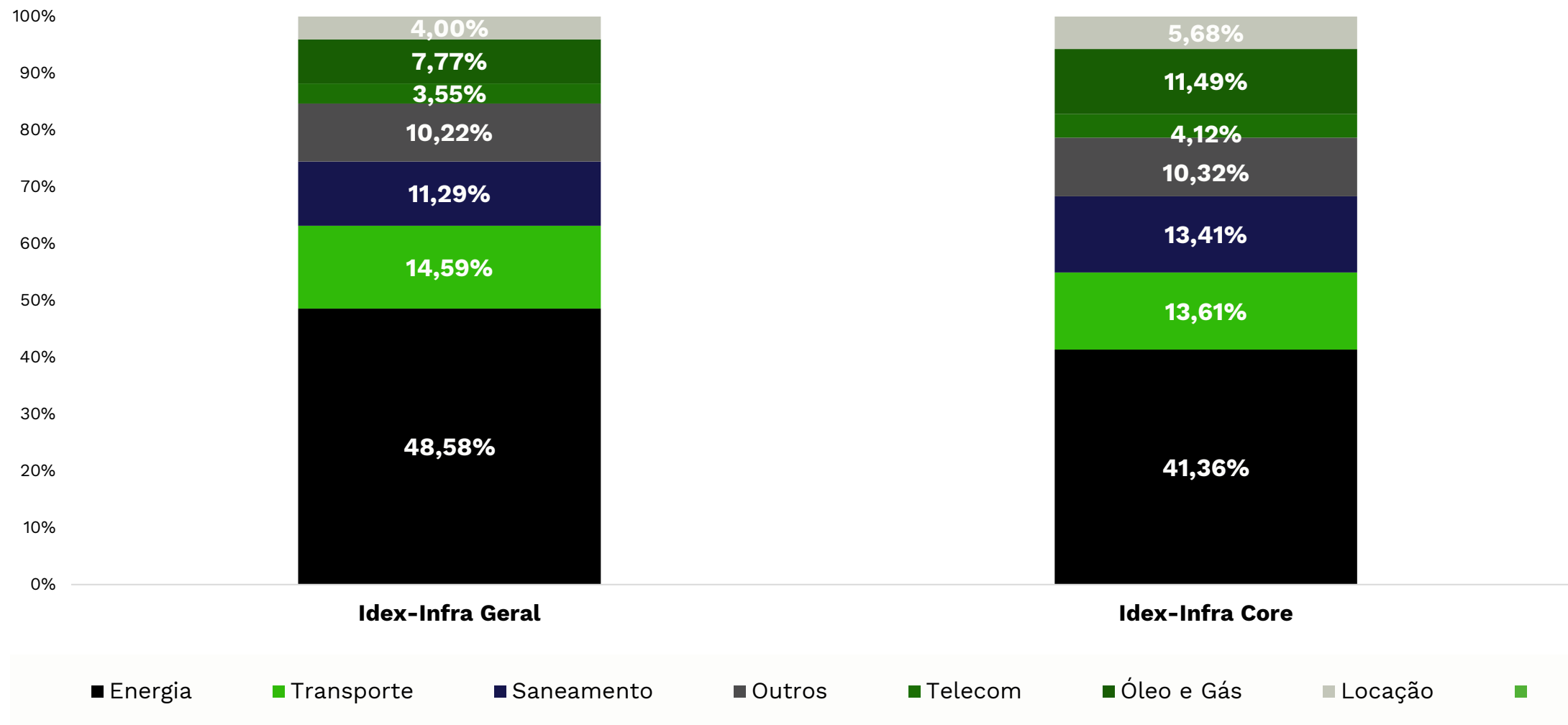


Evolução mensal dos spreads médios: Idex - Infra Geral e Idex - Infra Core



Fonte: JGP

Exposição por Setor (29/02/24)

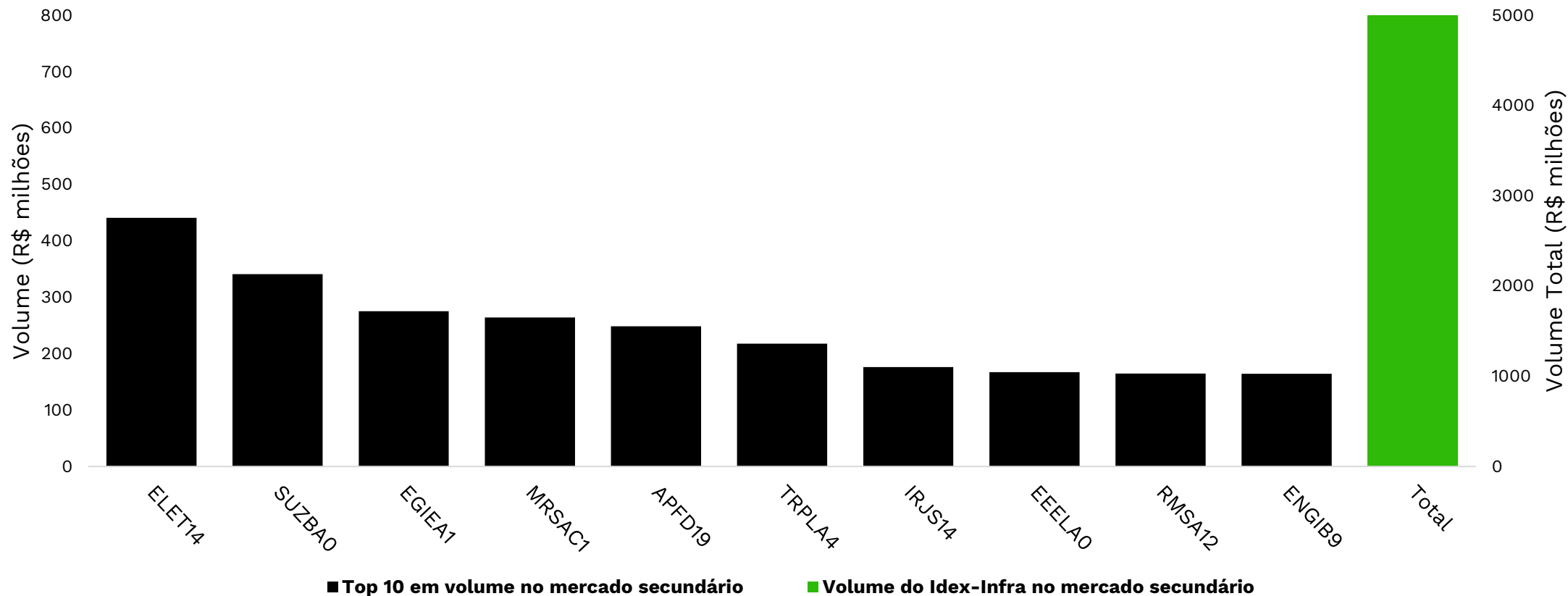


Fonte: JGP

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 %	0,67 %										4,04 %
	Idex-Infra Core	0,61 %	2,66 %	0,63 %										3,94%
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 (01/03/24 — 28/03/24) em R\$ milhões



I dex-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
CNRD11	Concessionaria Da Rodovia Ms	5,97%
CAJS11	Concessionaria Aguas De Juturnaiba S/A	4,13%
SAPRB3	Sanepar	3,59%
XNGU17	Xingu Rio	2,91%
ENAT11	Enauta Participacoes S.A.	2,88%
IDEX-Infra Geral		0,67%

5 Melhores variações de carregos no período

Ativo	Empresa	Variação
CPTM15	Ligga Telecomunicacoes	1,36%
CASN23	Casan	1,27%
ANEM11	Anemus Wind Holding S.A.	1,19%
ANET11	Americanet	1,18%
ANET12	Americanet	1,18%
IDEX-Infra Geral		1,03%

5 Melhores variações a mercado no período

Ativo	Empresa	Variação
CNRD11	Concessionaria Da Rodovia Ms	4,80%
CAJS11	Concessionaria Aguas De Juturnaiba S/A	3,07%
SAPRB3	Sanepar	2,54%
XNGU17	Xingu Rio	1,87%
ENAT11	Enauta Participacoes S.A.	1,74%
IDEX-Infra Geral		-0,36%

5 Piores variações no período

Ativo	Empresa	Variação
AEAB11	Aes Cajuina Ab1 Holdings S.A.	-2,52%
PETR27	Petrobras	-1,18%
TCII11	Aes Tucano Holding li S.A	-1,13%
CTEE1B	Cteep	-1,05%
JALL13	Jalles Machado	-1,04%
IDEX-Infra Geral		0,67%

5 Piores variações de carregos no período

Ativo	Empresa	Variação
PRTE12	Paranaíba Transmissora De Energia	0,98%
PETR16	Petrobras	0,98%
FGEN13	Ferreira Gomes Energia	0,98%
ENMI21	Companhia Energética Miranda	0,98%
PETR26	Petrobras	0,98%
IDEX-Infra Geral		1,03%

5 Piores variações a mercado no período

Ativo	Empresa	Variação
AEAB11	Aes Cajuina Ab1 Holdings S.A.	-3,57%
ANEM11	Anemus Wind Holding S.A.	-2,20%
PETR27	Petrobras	-2,16%
TCII11	Aes Tucano Holding li S.A	-2,15%
JALL13	Jalles Machado	-2,06%
IDEX-Infra Geral		-0,36%

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