



**i9ADVISORY**  
CONSULTORIA FINANCEIRA

ACOMPANHAMENTO SEMESTRAL



**METRUS - PLANO FAMÍLIA**
**Compliance dos Investimentos e Enquadramento Legal - Resolução CMN n° 4.994**
**30 dezembro 2022**

ÍNDICE		RESOLUÇÃO CMN CMN n° 4.994	PÁGINA
<b>1.0</b>	<b>LIMITES DE ALOCAÇÕES</b>	<b>Artigos 20 a 25</b>	<b>3 a 5</b>
1.1	Segmento de Renda Fixa	Artigo 21	3
1.2	Segmento de Renda Variável	Artigo 22	4
1.3	Segmento Estruturados	Artigo 23	4
1.4	Segmento Imobiliário	Artigo 24	5
1.5	Segmento de Operações com Participantes	Artigo 25	5
1.6	Segmento Exterior	Artigo 26	5
1.7	Recusos Garantidores	---	5
<b>2.0</b>	<b>RESSALVAS, EXIGÊNCIAS E OBSERVAÇÕES</b>	<b>Capítulo V</b>	<b>6 e 7</b>
<b>3.0</b>	<b>LIMITES DE ALOCAÇÃO POR EMISSOR EM RELAÇÃO AO PLANO</b>	<b>Artigo 27</b>	<b>8</b>
<b>4.0</b>	<b>FUNDOS DE PRIMEIRO NÍVEL</b>	---	<b>9</b>
4.1	Liquidez	---	9
<b>5.0</b>	<b>VEDAÇÕES</b>	<b>Artigo 36</b>	<b>10</b>
<b>6.0</b>	<b>RESTRICÇÕES ESPECÍFICAS DEFINIDAS NA POLÍTICA DE INVESTIMENTO</b>	---	<b>11</b>
<b>7.0</b>	<b>RISCO DE CRÉDITO</b>	---	<b>12 e 13</b>
7.1	Matriz de Risco de Crédito	---	12
7.2	Grau Especulativo	---	13
<b>8.0</b>	<b>RISCO DE MERCADO</b>	---	<b>14 e 15</b>
<b>9.0</b>	<b>RENTABILIDADE</b>	---	<b>16 a 18</b>
9.1	Rentabilidade Consolidada	---	16
9.2	Rentabilidade por segmento	---	17

**METRUS - PLANO FAMÍLIA**
**Compliance dos Investimentos e Enquadramento Legal - Resolução CMN n° 4.994**
**30 dezembro 2022**

1.0	LIMITES DE ALOCAÇÃO	jul/22	ago/22	set/22	out/22	nov/22	dez/22	Limite Legal	POLÍTICA		STATUS	Alocação Atual (em R\$)
									Alocação Objetivo	Limite Superior		
1.1	SEGMENTO DE RENDA FIXA	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	✓	2.720.538,88
1.1.1	Títulos públicos	44,18%	43,06%	43,74%	42,81%	44,68%	42,54%	100,00%	---	100,00%	✓	1.157.393,97
1.1.2	Fundos de índices de títulos públicos negociados em bolsa	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	---	100,00%	✓	0,00
1.1.3	Ativos de renda fixa, exceto títulos públicos	55,82%	56,94%	56,26%	57,19%	55,32%	57,46%	80,00%	---	60,00%	✓	1.563.144,91
1.1.3.1	Ativos de instituições financeiras bancárias	40,47%	40,80%	39,98%	36,95%	38,75%	34,37%	80,00%	---	60,00%	✓	934.959,91
1.1.3.2	Ativos de sociedade por ações de capital aberto e securitizadoras	12,16%	12,87%	12,18%	11,19%	12,36%	11,80%	80,00%	---	60,00%	✓	320.912,34
1.1.3.3	Fundos de índices de renda fixa negociados em bolsa	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	---	0,00%	✓	0,00
1.1.3.4	Títulos das dívidas públicas mobiliárias estaduais e municipais	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	---	20,00%	✓	0,00
1.1.3.5	Obrigações de organismos multilaterais emitidas no País	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	---	20,00%	✓	0,00
1.1.3.6	Ativos de instituições financeiras não bancárias	0,49%	0,45%	0,29%	0,42%	0,44%	0,42%	20,00%	---	20,00%	✓	11.452,87
1.1.3.7	Debêntures emitidas por sociedade por ações de capital fechado	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	---	20,00%	✓	0,00
1.1.3.8	FIDC e FICFIDC	2,42%	3,00%	3,13%	3,42%	3,60%	3,55%	20,00%	---	20,00%	✓	96.628,56
1.1.3.9	CCB e CCCB	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	---	0,00%	✓	0,00
1.1.3.10	CPR, CDCA, CRA e Warrant Agropecuário	0,13%	0,17%	0,18%	0,19%	0,21%	0,21%	20,00%	---	20,00%	✓	5.844,60
1.1.3.11	Caixa, Valores a Pagar/Receber	0,14%	-0,34%	0,51%	5,02%	-0,04%	7,11%	---	---	---	---	193.346,62

No encerramento do 2º semestre de 2022, o METRUS - PLANO FAMÍLIA estava de acordo com todos os limites estabelecidos na Política de Investimentos vigente e os limites do Art. 21 da Resolução CMN n° 4.994.

O limite estabelecido no item 1.1.3.4 é válido somente se emitidos antes da vigência da Lei Complementar nº 148, de 25 de dezembro de 2014.

**METRUS - PLANO FAMÍLIA**
**Compliance dos Investimentos e Enquadramento Legal - Resolução CMN n° 4.994**
**30 dezembro 2022**

1.0	LIMITES DE ALOCAÇÃO	jul/22	ago/22	set/22	out/22	nov/22	dez/22	Limite Legal	POLÍTICA		STATUS	Alocação Atual (em R\$)
									Alocação Objetivo	Limite Superior		
1.2	<b>SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL</b>	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	<b>70,00%</b>	---	<b>15,00%</b>	✓	0,00
1.2.1	Ações com nível de governança corporativa	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	<b>70,00%</b>	---	<b>15,00%</b>	✓	0,00
1.2.2	Ações sem nível de governança corporativa	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	<b>50,00%</b>	---	<b>15,00%</b>	✓	0,00
1.2.3	Brazilian Depositary Receipts (BDRs) e BDRs de ETFs níveis II e III	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	<b>10,00%</b>	---	<b>10,00%</b>	✓	0,00
1.2.4	Outros (CEPAC, Ouro, Carbono, etc.)	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	<b>3,00%</b>	---	<b>3,00%</b>	✓	0,00
1.2.5	Valores a Pagar/Receber e Derivativos	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	---	---	---	---	0,00
1.3	<b>SEGMENTO ESTRUTURADOS</b>	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	<b>20,00%</b>	---	<b>20,00%</b>	✓	7,85
1.3.1	Fundos de Participação	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	<b>15,00%</b>	---	<b>0,00%</b>	✓	0,00
1.3.2	Fundos Multimercado Estruturado	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	<b>15,00%</b>	---	<b>15,00%</b>	✓	7,85
1.3.3	Fundos classificados como "Ações - Mercado de Acesso"	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	<b>15,00%</b>	---	<b>15,00%</b>	✓	0,00
1.3.4	Certificado de Operações Estruturadas (COEs)	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	<b>10,00%</b>	---	<b>10,00%</b>	✓	0,00

No encerramento do 2º semestre de 2022, o METRUS - PLANO FAMÍLIA estava de acordo com todos os limites estabelecidos na Política de Investimentos vigente e os limites dos Arts. 22 e 23 da Resolução CMN n° 4.994.



**METRUS - PLANO FAMÍLIA**
**Compliance dos Investimentos e Enquadramento Legal - Resolução CMN n° 4.994**
**30 dezembro 2022**

1.0	LIMITES DE ALOCAÇÃO	jul/22	ago/22	set/22	out/22	nov/22	dez/22	Limite Legal	POLÍTICA		STATUS	Alocação Atual (em R\$)
									Alocação Objetivo	Limite Superior		
1.4	<b>SEGMENTO IMOBILIÁRIO</b>	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	---	10,00%	✓	0,00
1.4.1	Fundos Imobiliários e cotas de Fundos Imobiliários	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	---	10,00%	✓	0,00
1.4.2	Certificados de Recebíveis Imobiliários (CRIs)	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	---	10,00%	✓	0,00
1.4.3	Cédula de Crédito Imobiliários (CCIs)	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	---	10,00%	✓	0,00
1.4.4	Imóveis	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	---	---	---	---	0,00
1.5	<b>SEGMENTO DE OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES</b>	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	---	10,00%	✓	0,00
1.6	<b>SEGMENTO EXTERIOR</b>	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	---	10,00%	✓	0,00
1.6.1	Cotas de Fis e FICFIs classificados como "Divida Externa" ou títulos da dívida pública mobiliária federal externa	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	---	10,00%	✓	0,00
1.6.2	Fundos com sufixo "Investimentos no Exterior" que invistam no mínimo 67% em FIs no exterior	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	---	10,00%	✓	0,00
1.6.3	Fundos com sufixo "Investimentos no Exterior" que invistam menos que 67% em FIs no exterior	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	---	10,00%	✓	0,00
1.6.4	BDRs classificados como nível I	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	---	10,00%	✓	0,00
1.6.5	Demais ativos financeiros no exterior	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	---	10,00%	✓	0,00
1.7	<b>RECURSOS GARANTIDORES</b>											R\$ 2.720.594,54

No encerramento do 2º semestre de 2022, o METRUS - PLANO FAMÍLIA estava de acordo com todos os limites da Política de Investimentos vigente e os limites dos Arts. 24, 25 e 26 da Resolução CMN n° 4.994.

## Compliance dos Investimentos e Enquadramento Legal - Resolução CMN nº 4.994

30 dezembro 2022

2.0	RESSALVAS, EXIGÊNCIAS E OBSERVAÇÕES	STATUS
2.1	As operações compromissadas devem ser lastreadas em títulos da dívida pública mobiliária federal interna.	✓
2.2	Os ativos financeiros de renda fixa de emissão de sociedades por ações de capital fechado e sociedades limitadas somente poderão ser adquiridos com coobrigação de instituição financeira bancária autorizada a funcionar pelo Banco Central do Brasil.	✓
2.3	As CCCB lastreadas em CCB emitidas por sociedades por ações de capital fechado e sociedades limitadas somente poderão ser adquiridas caso as referidas CCB sejam coobrigadas por instituição financeira bancária autorizada a funcionar pelo Banco Central do Brasil.	✓
2.4	A EFPC deve se certificar de que o FIP seja qualificado como entidade de investimento, conforme regulamentação da Comissão de Valores Mobiliários.	✓
2.5	O FIP deve prever em seu regulamento a determinação de que o gestor do fundo de investimento, ou gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, mantenha, no mínimo, 3% (três por cento) do capital subscrito do fundo.	✓
2.6	É vedada a inserção de cláusula no regulamento do FIP que estabeleça preferência, privilégio ou tratamento diferenciado de qualquer natureza ao gestor e/ou pessoas ligadas em relação aos demais cotistas.	✓
2.7	Os investimentos realizados por meio de FIM e FICFIM não classificados como estruturado ou no segmento exterior serão consolidados com as posições dos ativos das carteiras próprias e carteiras administradas para fins de verificação dos limites.	✓
2.8	As CCI de emissão de sociedades por ações de capital fechado e sociedades limitadas somente poderão ser adquiridas com coobrigação de instituição financeira bancária autorizada a funcionar pelo Banco Central do Brasil.	✓
2.9	Os contratos das operações de empréstimos aos participantes devem conter cláusula de consignação em pagamento da reserva até o valor estipulado para o instituto do resgate.	✓
2.10	Os contratos de financiamentos imobiliários a participantes e assistidos devem conter cláusulas de: alienação fiduciária do imóvel objeto do financiamento; e contratação de seguro com cobertura de Morte, Invalidez Permanente (MIP) e Danos Físicos ao Imóvel (DFI).	✓
2.11	Incluem-se no segmento de operações com participantes os valores mobiliários lastreados em recebíveis oriundos, direta ou indiretamente, dessas operações.	✓
2.12	Os encargos financeiros das operações com participantes devem ser superiores à taxa mínima atuarial, para planos constituídos na modalidade de benefício definido, ou ao índice de referência estabelecido na política de investimentos, para planos constituídos em outras modalidades, acrescidos de taxa referente à administração das operações e de taxa adicional de risco.	✓
2.13	Os ativos financeiros emitidos no exterior com risco de crédito que componham a carteira dos fundos de investimento constituídos no Brasil de que tratam os itens 1.6.2 e 1.6.5 da Resolução nº 4.994, de 24 de março de 2022 Página 10 de 17 caput sejam classificados como grau de investimento por agência de classificação de risco registrada na Comissão de Valores Mobiliários ou reconhecida por essa autarquia.	✓
2.14	Os gestores dos fundos de investimentos constituídos no exterior estejam em atividade há mais de cinco anos e administrem montante de recursos de terceiros superior a US\$5.000.000.000,00 (cinco bilhões de dólares dos Estados Unidos da América) na data do investimento.	✓

## Compliance dos Investimentos e Enquadramento Legal - Resolução CMN nº 4.994

30 dezembro 2022

2.0	RESSALVAS, EXIGÊNCIAS E OBSERVAÇÕES	STATUS
2.15	Os fundos de investimento constituídos no exterior possuam histórico de performance superior a doze meses.	✓
2.16	Para os títulos emitidos no exterior da dívida pública brasileira ou para ativos financeiros emitidos no exterior de empresa brasileira constituída sob a forma de sociedade anônima de capital aberto não há a necessidade de grau de investimeto por agência de classificação de risco.	✓
2.17	É vedada a aquisição de cotas de fundo de investimento com o sufixo “Investimento no Exterior” cujo regulamento não atenda à regulamentação para investidor qualificado nos termos estabelecidos pela Comissão de Valores Mobiliários.	✓
2.18	É vedada a aquisição direta ou indireta de cotas de fundo de investimento em participações com o sufixo “Investimento no Exterior”.	✓
2.19	Os fundos de investimento constituídos no Brasil que invistam no mínimo 67% de seu PL em cotas de fundos no exterior somente poderão adquirir ativos financeiros emitidos no exterior mediante a aquisição de cotas de fundos de investimento constituídos no exterior, incluídas as cotas de fundos de índice.	✓
2.20	A exigência de grau de investimento para os ativos financeiros emitidos no exterior com risco de crédito que componham a carteira dos fundos de investimento não dispensa a necessária avaliação de risco pela EFPC.	✓

---

No encerramento do 2º semestre de 2022, o METRUS - PLANO FAMÍLIA estava de acordo com todos os limites da Política de Investimentos vigente e os limites do Capítulo V da Resolução CMN nº 4.994.

## Compliance dos Investimentos e Enquadramento Legal - Resolução CMN n° 4.994

30 dezembro 2022

3.0	LIMITES DE ALOCAÇÃO POR EMISSOR EM RELAÇÃO AO PLANO	LIMITE LEGAL	POLÍTICA DE INVESTIMENTOS	STATUS
3.1	Tesouro Nacional	100,00%	100,00%	✓
3.2	Instituição Financeira Bancária	20,00%	20,00%	✓
3.3	Demais Emissores	10,00%	10,00%	✓

---

No encerramento do 2º Semestre de 2022, o Metrus Plano I BD estava de acordo com todos os limites estabelecidos na Política de Investimentos vigente e os limites do Art. 27 da Resolução CMN n° 4.994. As maiores alocações em Instituições Financeiras estavam no BTG PACTUAL (9,18%); no PAN (6,60%); e no DAYCOVAL (6,59%). As maiores alocações em Companhias Abertas e Demais Emissores estavam na LOCAMÉRICA (0,75%); na JSL (0,72%); e na AEGEA (0,66%). As maiores alocações em FIDCs estavam em CLIENTES BRF FIDC SÊNIOR (1,07%); em LIGHT FIDC SÊNIOR 1 (0,23%); e na CRÉDITO UNIVERSITÁRIO FIDC SÊNIOR 29 (0,21%).



## Compliance dos Investimentos e Enquadramento Legal - Resolução CMN n° 4.994

30 dezembro 2022

4.0	FUNDOS DE PRIMEIRO NÍVEL	PL ALOCADO	PL DO FUNDO	LIQUIDEZ	EXPOSIÇÃO
	AF INVEST GERAES FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	R\$ 1.020.219,43	R\$ 844.446.939,23	1	0,12%
	KINEA ABSOLUTO FIC RENDA FIXA IPCA	R\$ 425.498,96	R\$ 755.502.050,69	1	0,06%
	PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	R\$ 293.829,45	R\$ 5.220.944.444,89	1	0,01%

4.1	LIQUIDEZ	LIQUIDEZ (R\$)	ACUMULADO (R\$)	LIQUIDEZ (%)	ACUMULADO (%)
	21 DIAS ÚTEIS	R\$ 1.893.762,47	R\$ 1.893.762,47	69,61%	69,61%
	1 ANO	R\$ 0,00	R\$ 1.893.762,47	0,00%	69,61%
	5 ANOS	R\$ 659.390,66	R\$ 2.553.153,13	24,24%	93,85%

## Compliance dos Investimentos e Enquadramento Legal - Resolução CMN n° 4.994

30 dezembro 2022

5.0	VEDAÇÕES	STATUS
5.1	Realizar operações de compra e venda, ou qualquer outra forma de troca de ativos entre planos de uma mesma EFPC	✓
5.2	Realizar operações de crédito, inclusive com suas patrocinadoras, ressalvados os casos expressamente previstos no art. 25 da Resolução CMN n° 4.994	✓
5.3	Aplicar em ativos financeiros de emissão de pessoas físicas	✓
5.4	Aplicar em ativos financeiros de emissão de sociedades limitadas, ressalvados os casos expressamente previstos na Resolução	✓
5.5	Aplicar em ações e demais ativos financeiros de emissão de sociedades por ações de capital fechado, ressalvados os casos expressamente previstos na Resolução	✓
5.6	Manter posições em mercados derivativos, diretamente ou por meio de fundo de investimento: a descoberto ou que gerem alavancagem	✓
5.7	Realizar day trade, exceto as realizadas em plataformas eletrônicas ou em bolsa, justificadas em relatório atestado pelo AETQ	✓
5.8	Aplicar no exterior, ressalvados os casos expressamente previstos nesta Resolução	✓
5.9	Prestar fiança, aval, aceite ou coobrigar-se de qualquer forma	✓
5.10	Atuar como incorporadora, de forma direta ou indireta	✓
5.11	Adquirir terrenos e imóveis	✓
5.12	Realizar operações fora do mercado de balcão organizado ou bolsa de valores, exceto para: distribuição pública de ações; exercício do direito de preferência; conversão de debêntures em ações; exercício de bônus ou de recebidos de subscrição; casos que envolvam negociação de participação relevante conforme regulamentação da Previc; e demais casos expressamente previstos na Resolução	✓
5.13	Locar, emprestar, tomar emprestado, empenhar ou caucionar ativos financeiros, exceto nas seguintes hipóteses: depósito de garantias em operações com derivativos no âmbito de cada plano de benefícios; operações de empréstimos de ativos financeiros, nos termos do art. 29 na Resolução; e depósito de garantias de ações judiciais no âmbito de cada plano administrado pela EFPC	✓

No encerramento do 2º semestre de 2022, o METRUS - PLANO FAMÍLIA estava de acordo com todos os limites da Política de Investimentos vigente e os limites do Arts. 36 da Resolução CMN n° 4.994.

**Compliance dos Investimentos e Enquadramento Legal - Resolução CMN n° 4.994****30 dezembro 2022**

6.0	RESTRIÇÕES ESPECÍFICAS DEFINIDAS NA POLÍTICA DE INVESTIMENTO	LIMITE LEGAL	POLÍTICA DE INVESTIMENTOS	STATUS
6.1	Na aplicação dos recursos, o METRUS PLANO I BD observa as vedações estabelecidas pela Resolução CMN n° 4.994 e atualizações para as modalidades de investimento elegíveis.	---	---	---
6.2	Operações realizadas em ativos financeiros ligados à patrocinadora e a fornecedores, clientes e demais empresas ligadas ao grupo econômico da patrocinadora são vedadas para todos os planos de benefícios, PGA e para os recursos livres do Plano Assistencial.	---	---	---

## Compliance dos Investimentos e Enquadramento Legal - Resolução CMN n° 4.994

30 dezembro 2022

## 7.0 RISCO DE CRÉDITO

## 7.1 Matriz de Risco de Crédito

Rating	LH	NP	CDB	DPGE	LF	RDB	DEB	CCI	CRI	FIDC	LC	Outros	Total	Limite PI	Status
AAA	---	0,05%	0,45%	---	7,63%	---	3,99%	---	---	1,65%	---	---	13,78%	60,00%	✓
AA	---	---	0,21%	---	18,16%	---	5,84%	---	---	0,40%	---	---	24,62%	60,00%	✓
A	---	---	0,00%	---	7,71%	---	1,29%	---	---	---	---	---	9,00%	60,00%	✓
BBB	---	---	---	0,04%	0,13%	---	0,11%	---	---	---	---	---	0,28%	60,00%	✓
BB	---	---	---	---	---	---	0,30%	---	---	---	---	---	0,30%	5,00%	✓
B	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	0,00%	5,00%	✓
CCC	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	0,00%	5,00%	✓
CC	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	0,00%	5,00%	✓
C	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	0,00%	5,00%	✓
D	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	0,00%	5,00%	✓
Sem Nota	---	---	---	---	0,23%	---	0,21%	---	---	1,50%	---	0,21%	2,16%	5,00%	✓
<b>Total</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,05%</b>	<b>0,66%</b>	<b>0,04%</b>	<b>33,87%</b>	<b>0,00%</b>	<b>11,74%</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>3,55%</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,21%</b>	<b>50,13%</b>	<b>60,00%</b>	<b>✓</b>
<b>Especulativo</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,23%</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,51%</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>1,50%</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,21%</b>	<b>2,45%</b>	<b>5,00%</b>	<b>✓</b>

## Compliance dos Investimentos e Enquadramento Legal - Resolução CMN nº 4.994

30 dezembro 2022

## 7.0 RISCO DE CRÉDITO

## 7.2 Grau Especulativo

Veículo	Contraparte	Financeiro	% Total	Vencimento	Taxa	Rating
FIDC	HAMPTON FIDC SUBORDINADA SENIOR	R\$ 642,69	0,02%	---	---	Sem Rating
FIDC	TRAVESSIA FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITARIOS	R\$ 33.340,03	1,23%	---	---	Sem Rating
LETRA FINANCEIRA	AGIBANK (EX GERADOR)	R\$ 5.922,15	0,22%	2023-09-01	CDI + 2,1%	Sem Rating
LETRA FINANCEIRA	AGIBANK (EX GERADOR)	R\$ 288,89	0,01%	2023-09-01	CDI + 2,1%	Sem Rating
CRA	ISEC SECURITIZADORA	R\$ 1.909,85	0,07%	2025-04-15	CDI + 2%	Sem Rating
CRA	ISEC SECURITIZADORA	R\$ 197,35	0,01%	2025-04-15	CDI + 2%	Sem Rating
CRA	ISEC SECURITIZADORA	R\$ 3.737,40	0,14%	2031-04-15	IPCA + 7,86%	Sem Rating
DEBENTURE	B2W	R\$ 1.755,00	0,06%	2030-12-16	IPCA + 7,98%	Sem Rating
DEBENTURE	B2W	R\$ 274,90	0,01%	2030-12-16	IPCA + 7,98%	Sem Rating
DEBENTURE	ONCOCLINICAS BRASIL SERVICOS MEDICOS	R\$ 3.710,76	0,14%	2027-11-25	CDI + 1,62%	Sem Rating
DEBENTURE	PETRO RIO JAGUAR PETROLEO	R\$ 3.889,42	0,14%	2032-08-15	PRE + 8,19%	BB
DEBENTURE	PETRO RIO JAGUAR PETROLEO	R\$ 467,59	0,02%	2032-08-15	PRE + 8,19%	BB
DEBENTURE	UNIGEL PARTICIPAÇÕES S.A.	R\$ 3.702,76	0,14%	2027-04-08	CDI + 1,8%	BB
FIDC	FS FORTALECE FIDC 1 SÊNIOR	R\$ 2.591,89	0,10%	---	---	Sem Rating
FICFIDC	NIOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULT	R\$ 4.348,11	0,16%	---	---	Sem Rating
<b>Total</b>		<b>R\$ 66.778,78</b>	<b>2,45%</b>			

No encerramento do 2º semestre de 2022, o METRUS - PLANO FAMÍLIA possuía ativos classificados como grau especulativo segundo os limites da Política de Investimentos vigente. O montante dos ativos somava R\$ 66.778,78 , representando 2,45% dos recursos do plano.



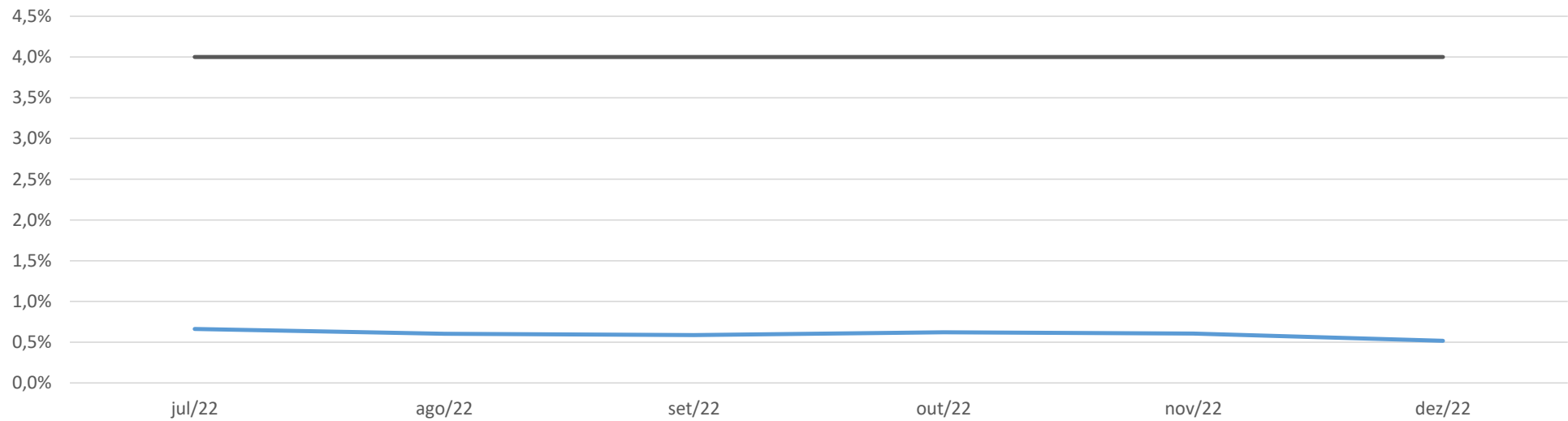
Compliance dos Investimentos e Enquadramento Legal - Resolução CMN nº 4.994

30 dezembro 2022

8.0 RISCO DE MERCADO

8.1 Value at Risk (VaR)

8.1.1 Consolidado



	jan/22	fev/22	mar/22	abr/22	mai/22	jun/22	jul/22	ago/22	set/22	out/22	nov/22	dez/22
<b>PLANO FAMÍLIA</b>	---	---	---	---	---	---	0,66%	0,60%	0,59%	0,62%	0,60%	0,52%
<b>LIMITE</b>	---	---	---	---	---	---	4,00%	4,00%	4,00%	4,00%	4,00%	4,00%

No decorrer do 2º semestre de 2022, o VaR do METRUS - PLANO FAMÍLIA manteve-se de acordo com o limite estabelecido na Política de Investimentos vigente.

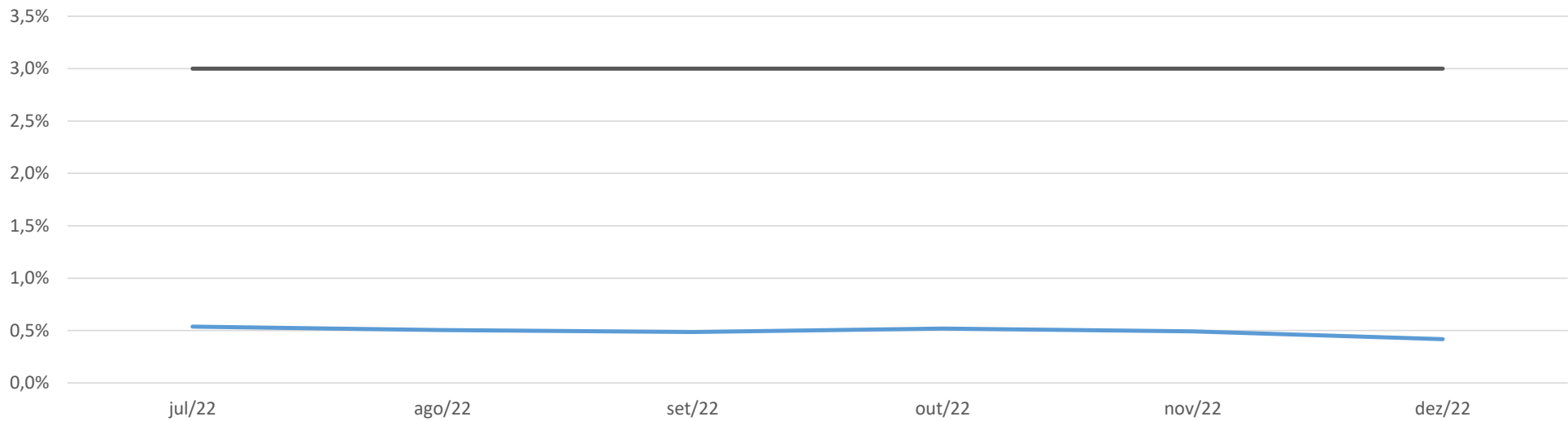
Compliance dos Investimentos e Enquadramento Legal - Resolução CMN nº 4.994

30 dezembro 2022

8.0 RISCO DE MERCADO

8.1 Value at Risk (VaR)

8.1.2 Mandato Renda Fixa Consolidado



	jan/22	fev/22	mar/22	abr/22	mai/22	jun/22	jul/22	ago/22	set/22	out/22	nov/22	dez/22
<b>RENDA FIXA</b>	---	---	---	---	---	---	0,54%	0,50%	0,49%	0,52%	0,49%	0,42%
<b>LIMITE</b>	---	---	---	---	---	---	3,00%	3,00%	3,00%	3,00%	3,00%	3,00%

No decorrer do 2º semestre de 2022, o VaR do Mandato Renda Fixa Consolidado do METRUS - PLANO FAMÍLIA manteve-se de acordo com limite estabelecido na Política de Investimentos vigente.

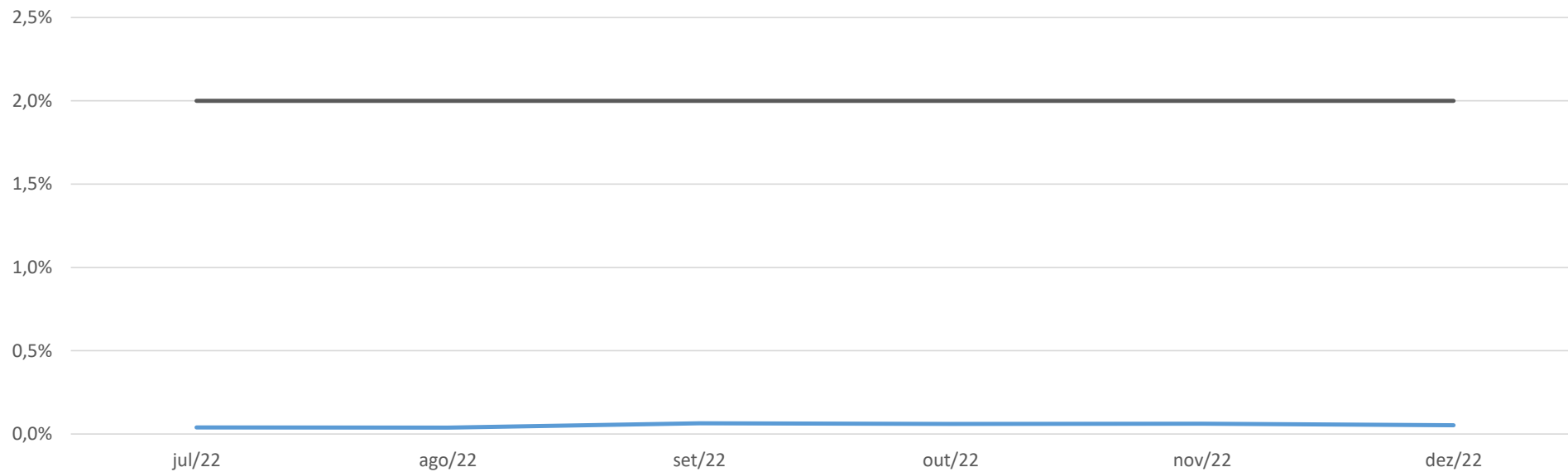
Compliance dos Investimentos e Enquadramento Legal - Resolução CMN nº 4.994

30 dezembro 2022

8.0 RISCO DE MERCADO

8.1 Value at Risk (C - VaR)

8.1.3 VaR de Crédito



	jan/22	fev/22	mar/22	abr/22	mai/22	jun/22	jul/22	ago/22	set/22	out/22	nov/22	dez/22
<b>CRÉDITO</b>	---	---	---	---	---	---	0,04%	0,04%	0,06%	0,06%	0,06%	0,05%
<b>LIMITE</b>	---	---	---	---	---	---	2,00%	2,00%	2,00%	2,00%	2,00%	2,00%

No decorrer do 2º semestre de 2022, o C-VaR do Mandato Renda Fixa do Plano Família estava de acordo com limite estabelecido na Política de Investimentos vigente.

**9.0 RENTABILIDADE**

9.1 Rentabilidade Consolidada



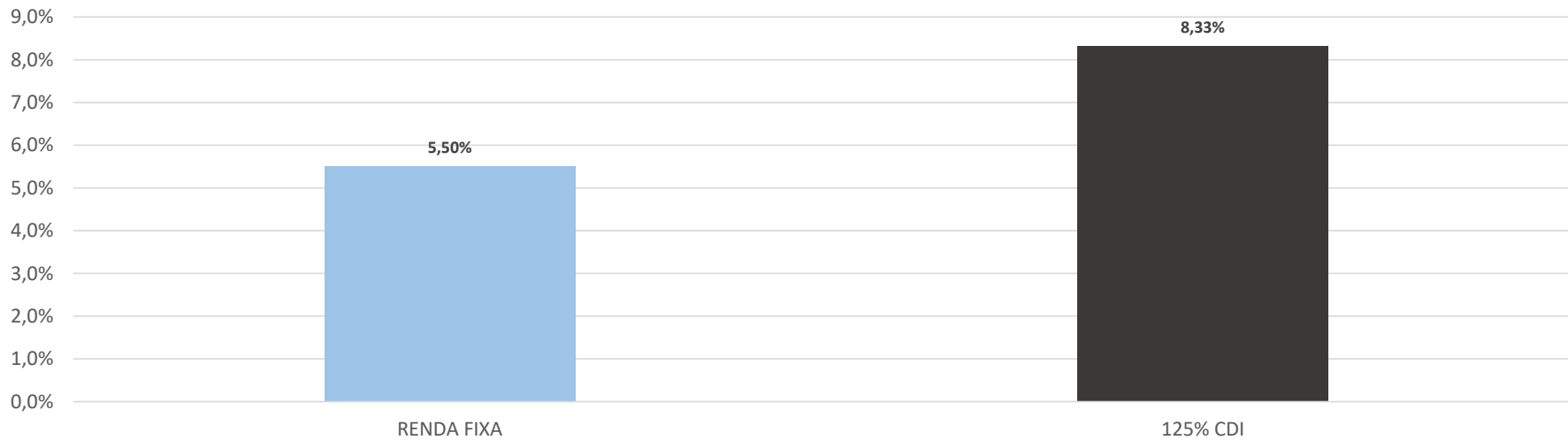
	jan/22	fev/22	mar/22	abr/22	mai/22	jun/22	1º Semestre	jul/22	ago/22	set/22	out/22	nov/22	dez/22	2º semestre
<b>CARTEIRA CONSOLIDADA</b>	0,87%	0,93%	1,64%	1,17%	0,96%	0,77%	▼ 6,51%	0,73%	0,85%	0,91%	1,40%	0,36%	1,13%	▼ 5,50%
125% CDI	0,92%	0,94%	1,16%	1,04%	1,29%	1,27%	6,81%	1,29%	1,46%	1,34%	1,28%	1,28%	1,40%	8,33%

Compliance dos Investimentos e Enquadramento Legal - Resolução CMN nº 4.994

30 dezembro 2022

9.0 RENTABILIDADE

9.2 Rentabilidade Renda Fixa



	jan/22	fev/22	mar/22	abr/22	mai/22	jun/22	1º Semestre	jul/22	ago/22	set/22	out/22	nov/22	dez/22	2º semestre
<b>RENDA FIXA</b>	0,87%	0,93%	1,64%	1,17%	0,96%	0,77%	▼ 6,51%	0,73%	0,85%	0,91%	1,40%	0,36%	1,13%	▼ 5,50%
<b>125% CDI</b>	0,92%	0,94%	1,16%	1,04%	1,29%	1,27%	6,81%	1,29%	1,46%	1,34%	1,28%	1,28%	1,40%	8,33%



## Compliance dos Investimentos e Enquadramento Legal - Resolução CMN nº 4.994

30 dezembro 2022

## 9.0 RENTABILIDADE

## 9.3 Rentabilidade dos Fundos

FUNDOS/BENCHMARKS	jan/22	fev/22	mar/22	abr/22	mai/22	jun/22	1º Semestre	jul/22	ago/22	set/22	out/22	nov/22	dez/22	2º semestre
AF INVEST GERAES FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,77%	0,88%	1,47%	0,87%	1,07%	1,06%	<b>6,28%</b>	1,08%	1,23%	1,16%	1,08%	1,11%	1,19%	<b>7,04%</b>
KINEA IPCA ABSOLUTO FIC RENDA FIXA	0,84%	1,62%	2,57%	1,41%	0,44%	0,09%	<b>7,16%</b>	0,51%	0,37%	0,29%	1,94%	-0,49%	1,19%	<b>3,86%</b>
PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	0,80%	0,82%	1,02%	0,88%	1,11%	1,05%	<b>5,82%</b>	1,08%	1,23%	1,14%	1,09%	1,09%	1,17%	<b>7,00%</b>
125% CDI	0,92%	0,94%	1,16%	1,04%	1,29%	1,27%	<b>6,81%</b>	1,29%	1,46%	1,34%	1,28%	1,28%	1,40%	<b>8,33%</b>



**i9ADVISORY**