

**MB Matic Renda Fixa Longo Prazo
Fundo de Investimento Financeiro
CNPJ nº 04.570.232/0001-36
(Administrado pela Mercantil do
Brasil Corretora S.A. - Câmbio, Títulos
e Valores Mobiliários)**

Demonstrações Financeiras Referentes ao
Exercício Findo em 31 de Dezembro de 2022 e
Relatório do Auditor Independente

Deloitte Touche Tohmatsu Auditores Independentes Ltda.

RELATÓRIO DO AUDITOR INDEPENDENTE SOBRE AS DEMONSTRAÇÕES FINANCEIRAS

Aos Cotistas e à Administradora do
MB Matic Renda Fixa Longo Prazo Fundo de Investimento Financeiro
(Administrado pela Mercantil do Brasil Corretora S.A. - Câmbio, Títulos e Valores Mobiliários)
Belo Horizonte - MG

Opinião

Examinamos as demonstrações financeiras do MB Matic Renda Fixa Longo Prazo Fundo de Investimento Financeiro ("Fundo"), que compreendem o demonstrativo da composição e diversificação das aplicações em 31 de dezembro de 2022 e a respectiva demonstração das evoluções do patrimônio líquido para o exercício findo nessa data, bem como as correspondentes notas explicativas, incluindo o resumo das principais políticas contábeis.

Em nossa opinião, as demonstrações financeiras acima referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do MB Matic Renda Fixa Longo Prazo Fundo de Investimento Financeiro em 31 de dezembro de 2022 e o desempenho de suas operações para o exercício findo nessa data, de acordo com as práticas contábeis adotadas no Brasil, aplicáveis aos fundos de investimento regulamentados pela Instrução da Comissão de Valores Mobiliários - CVM nº 555, de 17 de dezembro de 2014 ("ICVM 555/14").

Base para opinião

Nossa auditoria foi conduzida de acordo com as normas brasileiras e internacionais de auditoria. Nossas responsabilidades, em conformidade com tais normas, estão descritas na seção a seguir intitulada "Responsabilidades do auditor pela auditoria das demonstrações financeiras". Somos independentes em relação ao Fundo de acordo com os princípios éticos relevantes previstos no Código de Ética Profissional do Contador e nas normas profissionais emitidas pelo Conselho Federal de Contabilidade, e cumprimos com as demais responsabilidades éticas de acordo com essas normas. Acreditamos que a evidência de auditoria obtida é suficiente e apropriada para fundamentar nossa opinião.

Principais assuntos de auditoria

Principais assuntos de auditoria são aqueles que, em nosso julgamento profissional, foram os mais significativos em nossa auditoria do exercício. Esses assuntos foram tratados no contexto de nossa auditoria das demonstrações financeiras como um todo e na formação de nossa opinião sobre as demonstrações financeiras e, portanto, não expressamos uma opinião separada sobre esses assuntos.

Existência de ativos financeiros (nota explicativa nº 7)

Em 31 de dezembro de 2022, o Fundo detinha em seu portfólio ativos financeiros representados por operações compromissadas e títulos e valores mobiliários representados por títulos públicos federais e letras financeiras. Cabe à Administradora do Fundo conduzir processos de controle que garantam a propriedade e a custódia dos ativos mantidos em sua carteira. Devido à relevância dos saldos desses investimentos em relação às demonstrações financeiras tomadas como um todo, consideramos esse assunto como uma área de foco em nossa auditoria.

A Deloitte refere-se a uma ou mais empresas da Deloitte Touche Tohmatsu Limited ("DTTL"), sua rede global de firmas-membro e suas entidades relacionadas (coletivamente, a "organização Deloitte"). A DTTL (também chamada de "Deloitte Global") e cada uma de suas firmas-membro e entidades relacionadas são legalmente separadas e independentes, que não podem se obrigar ou se vincular a terceiros. A DTTL, cada firma-membro da DTTL e cada entidade relacionada são responsáveis apenas por seus próprios atos e omissões, e não entre si. A DTTL não fornece serviços para clientes. Por favor, consulte www.deloitte.com/about para saber mais.

A Deloitte é líder global de auditoria, consultoria empresarial, assessoria financeira, gestão de riscos, consultoria tributária e serviços correlatos. Nossa rede global de firmas-membro e entidades relacionadas, presente em mais de 150 países e territórios (coletivamente, a "organização Deloitte"), atende a quatro de cada cinco organizações listadas pela Fortune Global 500®. Saiba como os cerca de 345 mil profissionais da Deloitte impactam positivamente seus clientes em www.deloitte.com.

Como o assunto foi conduzido em nossa auditoria?

Com o objetivo de avaliar a adequação das posições registradas no Fundo, nossos procedimentos de auditoria incluíram, entre outros: (i) a obtenção do acesso à carteira gerencial do Fundo e comparação com os seus respectivos registros contábeis; (ii) o confronto da carteira gerencial detalhada do Fundo em 31 de dezembro de 2022, com os relatórios de custódia emitidos pelas entidades custodiantes independentes; e (iii) a avaliação das divulgações efetuadas nas demonstrações financeiras do Fundo.

Baseados nos procedimentos de auditoria efetuados e nos resultados obtidos, consideramos que os processos adotados pela Administradora são apropriados para suportar a existência dos ativos financeiros, no contexto das demonstrações financeiras do Fundo tomadas como um todo.

Mensuração dos ativos financeiros

Em 31 de dezembro de 2022, o Fundo possuía 31,95% do seu patrimônio líquido investido em títulos e valores mobiliários privados avaliados a valor justo, representados por letras financeiras sem cotação disponível em mercado ativo (“ativos não cotados”). A avaliação a valor justo é efetuada por metodologia interna de precificação da Administradora, que considera, entre outros fatores, o risco de crédito, taxas de juros e curvas de rendimentos observáveis no mercado, bem como julgamentos e estimativas adotadas. Adicionalmente, cabe a Administradora do Fundo a avaliação periódica da adequação do risco de crédito, da curva de juros e dos modelos de precificação para as estimativas de valor justo sobre ativos não cotados. Devido a relevância dos valores envolvidos, combinado ao uso de estimativas para a valorização dos ativos conforme metodologia interna de precificação, consideramos esse assunto como área de foco em nossa auditoria.

Devido à relevância dos valores envolvidos, somando-se ao uso de estimativas para a valorização dos ativos com base em modelos matemáticos internos e dados observáveis de mercado, consideramos esse assunto relevante para a nossa auditoria.

Como o assunto foi conduzido em nossa auditoria?

Com o objetivo de avaliar a razoabilidade na mensuração do valor justo dos investimentos do Fundo em ativos não cotados, nossos procedimentos de auditoria incluíram, entre outros: (i) entendimento dos processos e controles de avaliação e monitoramento de riscos de crédito e de mercado para os ativos não cotados; (ii) leitura do manual de precificação, elaborado pela Administradora do Fundo, para entendimento do método de precificação dos ativos não cotados; (iii) recálculo do valor justo com base na metodologia interna; e (iv) a avaliação das divulgações efetuadas nas demonstrações contábeis do Fundo.

Considerando o manual de precificação e o resultado dos nossos procedimentos, os critérios e premissas adotados pela Administradora do Fundo na mensuração desses ativos financeiros privados não cotados, são consistentes e apropriados com as divulgações em notas explicativas, no contexto das demonstrações financeiras tomadas como um todo.

Responsabilidades da Administradora do Fundo pelas demonstrações financeiras

A Administradora é responsável pela elaboração e adequada apresentação das demonstrações financeiras de acordo com as práticas contábeis adotadas no Brasil aplicáveis aos fundos de investimento regulamentado pela Instrução CVM 555/14 e pelos controles internos que ela determinou como necessários para permitir a elaboração de demonstrações financeiras livres de distorção relevante, independentemente se causada por fraude ou erro.

Na elaboração das demonstrações financeiras, a Administradora é responsável pela avaliação da capacidade de o Fundo continuar operando e divulgando, quando aplicável, os assuntos relacionados com a sua continuidade operacional e o uso dessa base contábil na elaboração das demonstrações financeiras, a não ser que a Administradora pretenda liquidar o Fundo ou cessar suas operações, ou não tenha nenhuma alternativa realista para evitar o encerramento das operações.

Responsabilidades do auditor pela auditoria das demonstrações financeiras

Nossos objetivos são obter segurança razoável de que as demonstrações financeiras, tomadas em conjunto, estão livres de distorção relevante, independentemente se causada por fraude ou erro, e emitir relatório de auditoria contendo nossa opinião. Segurança razoável é um alto nível de segurança, mas não uma garantia de que a auditoria realizada de acordo com as normas brasileiras e internacionais de auditoria sempre detectam as eventuais distorções relevantes existentes. As distorções podem ser decorrentes de fraude ou erro e são consideradas relevantes quando, individualmente ou em conjunto, possam influenciar, dentro de uma perspectiva razoável, as decisões econômicas tomadas pelos usuários com base nas referidas demonstrações financeiras.

Como parte da auditoria realizada de acordo com as normas brasileiras e internacionais de auditoria, exercemos julgamento profissional, e mantemos ceticismo profissional ao longo da auditoria. Além disso:

- Identificamos e avaliamos os riscos de distorção relevante nas demonstrações financeiras, independentemente se causada por fraude ou erro, planejamos e executamos procedimentos de auditoria em resposta a tais riscos, bem como obtemos evidência de auditoria apropriada e suficiente para fundamentar nossa opinião. O risco de não detecção de distorção relevante resultante de fraude é maior do que o proveniente de erro, já que a fraude pode envolver o ato de burlar os controles internos, conluio, falsificação, omissão ou representações falsas intencionais.
- Obtivemos entendimento dos controles internos relevantes para a auditoria para planejarmos procedimentos de auditoria apropriados às circunstâncias, mas não com o objetivo de expressarmos opinião sobre a eficácia dos controles internos do Fundo.
- Avaliamos a adequação das políticas contábeis utilizadas e a razoabilidade das estimativas contábeis e respectivas divulgações feitas pela Administradora.
- Concluímos sobre a adequação do uso, pela Administradora, da base contábil de continuidade operacional e, com base nas evidências de auditoria obtidas, se existe incerteza relevante em relação a eventos ou condições que possam levantar dúvida significativa em relação à capacidade de continuidade operacional do Fundo. Se concluirmos que existe incerteza relevante, devemos chamar atenção em nosso relatório de auditoria para as respectivas divulgações nas demonstrações financeiras ou incluir modificação em nossa opinião, se as divulgações forem inadequadas. Nossas conclusões estão fundamentadas nas evidências de auditoria obtidas até a data de nosso relatório. Todavia, eventos ou condições futuras podem levar o Fundo a não mais se manter em continuidade operacional.
- Avaliamos a apresentação geral, a estrutura e o conteúdo das demonstrações financeiras, inclusive as divulgações e se as demonstrações financeiras representam as correspondentes transações e os eventos de maneira compatível com o objetivo de apresentação adequada.

Comunicamo-nos com a Administradora a respeito, entre outros aspectos, do alcance planejado, da época da auditoria e das constatações significativas de auditoria, inclusive as eventuais deficiências significativas nos controles internos que identificamos durante nossos trabalhos.

Dos assuntos que foram objeto de comunicação com os responsáveis pela Administração, determinamos aqueles que foram considerados como mais significativos na auditoria das demonstrações financeiras do exercício e que, dessa maneira, constituem os principais assuntos de auditoria. Descrevemos esses assuntos em nosso relatório de auditoria, a menos que lei ou regulamento tenha proibido divulgação pública do assunto, ou quando, em circunstâncias extremamente raras, determinarmos que o assunto não deve ser comunicado em nosso relatório porque as consequências adversas de tal comunicação podem, dentro de uma perspectiva razoável, superar os benefícios da comunicação para o interesse público.

São Paulo, 17 de abril de 2023



DELOITTE TOUCHE TOHMATSU
Auditores Independentes Ltda.
CRC nº 2 SP 011609/O-8



Wellington França Da Silva
Contador
CRC nº 1 SP 260165/O-1

DEMONSTRAÇÃO DA COMPOSIÇÃO E DIVERSIFICAÇÃO DAS APLICAÇÕES

POSIÇÃO EM : 31/12/2022

NOME DO FUNDO : MB MATIC RENDA FIXA LONGO PRAZO FUNDO
DE INVESTIMENTO FINANCEIRO

C.N.P.J.: 04.570.232/0001-36

ADMINISTRADORA : MERCANTIL DO BRASIL CORRETORA S. A. - CTVM

C.N.P.J.: 16.683.062/0001-85

Aplicações / Especificações	Vencimento	Quantidade	Posição final	
			Mercado/ Realização (R\$ Mil)	% sobre Patrimônio Líquido
DISPONIBILIDADES			16	0,83
OPERAÇÕES COMPROMISSADAS		22	278	14,37
- Letras Financeiras do Tesouro	01/09/2023	22	278	14,37
TÍTULOS FEDERAIS		82	1.031	53,31
- Letras Financeiras do Tesouro	01/03/2024	35	442	22,85
- Letras Financeiras do Tesouro	01/03/2026	14	176	9,10
- Letras Financeiras do Tesouro	01/09/2027	33	413	21,36
LETRAS FINANCEIRAS		4	618	31,95
- Banco Votorantim S.A.	20/03/2023	2	121	6,25
- Paraná Banco S.A.	02/05/2023	1	192	9,93
- Banco Mercantil do Brasil S.A.	23/05/2024	1	305	15,77
DESPESAS ANTECIPADAS			1	0,05
VALORES A PAGAR			(10)	(0,51)
PATRIMÔNIO LÍQUIDO			1.934	100,00

DEMONSTRAÇÕES DA EVOLUÇÃO DO PATRIMÔNIO LÍQUIDO

Exercícios findos em 31 de dezembro de 2022 e de 2021

NOME DO FUNDO : MB MATIC RENDA FIXA LONGO PRAZO FUNDO
DE INVESTIMENTO FINANCEIRO

C.N.P.J.: 04.570.232/0001-36

ADMINISTRADORA : MERCANTIL DO BRASIL CORRETORA S.A. - CTVM

C.N.P.J.: 16.683.062/0001-85

Valores em R\$ mil, exceto o valor
unitário das cotas

		EXERCÍCIOS	
		2022	2021
PATRIMÔNIO LÍQUIDO NO INÍCIO DO EXERCÍCIO:			
Representado por:	21.811,9756979 cotas a R\$ 111,4695754	2.431	
Cotas emitidas no exercício representado por:	9.009,4215852 cotas	1.057	
Cotas resgatadas no exercício representado por:	15.239,9968025 cotas	(1.626)	
Variação no Resgate de Cotas		(171)	
Patrimônio líquido antes do resultado:		1.691	
PATRIMÔNIO LÍQUIDO NO INÍCIO DO EXERCÍCIO:			
Representado por:	21.578,2918493 cotas a R\$ 100,0479493		2.158
Cotas emitidas no exercício representado por:	6.451,1530122 cotas		699
Cotas resgatadas no exercício representado por:	6.217,4691636 cotas		(627)
Variação no Resgate de Cotas			(49)
Patrimônio líquido antes do resultado:			2.181
<u>COMPOSIÇÃO DO RESULTADO DO EXERCÍCIO</u>			
A - RENDA FIXA E OUTROS TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS		276	297
A.1 - Apropriação de Rendimentos		276	297
A1.1 - Rendas de Aplicações Interfinanceiras de Liquidez		61	12
A1.2 - Rendas de Títulos e Valores Mobiliários e Instrumentos Financeiros Derivativos		215	100
A1.3 - Recuperação Massa Falida Banco Santos		-	185
C - DEMAIS DESPESAS		(33)	(47)
C.1 - Remuneração do Administrador		(11)	(12)
C.2 - Auditoria e Custódia		(19)	(31)
C.3 - Taxa de Fiscalização		(2)	(4)
C.4 - Despesas Diversas		(1)	-
Total do Resultado do Exercício		243	250
PATRIMÔNIO LÍQUIDO NO FINAL DO EXERCÍCIO:			
Representado por:	15.581,4004806 cotas a R\$ 124,1100299	1.934	
PATRIMÔNIO LÍQUIDO NO FINAL DO EXERCÍCIO:			
Representado por:	21.811,9756979 cotas a R\$ 111,4695754		2.431

**MB MATIC RENDA FIXA LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO
FINANCEIRO**

(CNPJ 04.570.232/0001-36)

(Administrado pela Mercantil do Brasil Corretora S.A. – CTVM)

(CNPJ 16.683.062/0001-85)

Notas explicativas da Administradora às demonstrações

financeiras em 31 de dezembro de 2022 e de 2021

Em milhares de reais, exceto quando indicado de outra forma

1 Contexto operacional

O MB Matic Renda Fixa Longo Prazo Fundo de Investimento Financeiro (“Fundo”) foi constituído em 17/02/2005 e iniciou suas atividades em 31/03/2005, sob forma de condomínio aberto, com prazo indeterminado de duração. Destina-se a acolher recursos com o objetivo de proporcionar aos seus participantes rentabilidade compatível à de investimentos tradicionais em renda fixa, mediante a administração criteriosa e racional de uma carteira de investimento basicamente composta por títulos de renda fixa pós e/ou prefixados, públicos ou privados, nos termos do regulamento.

Tais estratégias, da forma como são adotadas, podem resultar em significativas perdas patrimoniais para seus cotistas. Na hipótese do patrimônio líquido atingir níveis abaixo do mínimo exigido pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM, o Fundo deverá receber aporte de capital ou fica a Administradora obrigada a promover a liquidação ou incorporá-lo a outro fundo de investimento.

Os investimentos em fundos não são garantidos pela Administradora ou por qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Não obstante a diligência da Administradora no gerenciamento dos recursos do Fundo, a política de investimento coloca em risco o patrimônio deste, pelas características dos papéis que o compõem, os quais sujeitam-no às oscilações do mercado e aos riscos de crédito inerentes a tais investimentos, podendo, inclusive, ocorrer perda do capital investido.

A gestão da carteira do Fundo é realizada pela Mercantil do Brasil Corretora S.A. – CTVM (“Administradora”).

2 Apresentação das demonstrações financeiras

As demonstrações financeiras são elaboradas em conformidade com o Plano Contábil dos Fundos de Investimento – COFI e com observância das normas emanadas pela Comissão de Valores Mobiliários, em conformidade com a Instrução CVM nº 555 de 17/12/2014 e regulamentação complementar, e evidenciam todas as informações relevantes próprias das demonstrações financeiras, e somente elas, as quais estão consistentes com as utilizadas pela administração na sua gestão.

As demonstrações financeiras incluem, quando aplicável, estimativas e premissas na mensuração e avaliação dos ativos e instrumentos financeiros integrantes da carteira do Fundo. Desta forma, quando da efetiva liquidação financeira desses ativos e instrumentos financeiros, os resultados efetivos poderão ser diferentes dos estimados.

3 Principais práticas contábeis

A Administradora adota o regime de competência para as receitas e despesas do Fundo.

(a) Operações compromissadas

São operações com compromisso de recompra com vencimento em data futura, anterior ou igual à do vencimento dos títulos objeto da operação, valorizadas diariamente conforme a taxa de mercado da negociação da operação.

<u>Descrição</u>	<u>Natureza</u>	<u>Valor de custo</u>	<u>Valor de mercado</u>
- Letras Financeiras do Tesouro	Pública	278	278

MB MATIC RENDA FIXA LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO

(CNPJ 04.570.232/0001-36)

(Administrado pela Mercantil do Brasil Corretora S.A. – CTVM)

(CNPJ 16.683.062/0001-85)

Notas explicativas da Administradora às demonstrações financeiras em 31 de dezembro de 2022 e de 2021

Em milhares de reais, exceto quando indicado de outra forma

(b) Títulos e valores mobiliários

Apresentamos abaixo informações referentes à composição por montante, natureza da entidade emissora, faixa de vencimento e a comparação entre o valor de custo atualizado e o valor de mercado em 31 de dezembro de 2022:

<u>Títulos e Valores Mobiliários</u>	<u>Natureza</u>	<u>Até 360 dias</u>	<u>Acima de 360 dias</u>	<u>Valor de custo atualizado</u>	<u>Valor de mercado</u>
-Letras Financeiras do Tesouro	Pública		1.031	909	1.031
-Letras Financeiras Subordinadas	Privada	313	305	586	618
Total		313	1.336	1.495	1.649

De acordo com o estabelecido na Instrução CVM nº 577, de 7 de julho de 2016, os ativos financeiros são classificados de acordo com a intenção de negociação da Administradora, em duas categorias específicas, atendendo aos seguintes critérios de contabilização:

Ativos para negociação – Aqueles adquiridos com o objetivo de serem negociados frequentemente e de forma ativa, sendo contabilizados de acordo com o regime de competência.

Os ativos integrantes da carteira de Fundo, integralmente classificados na categoria de títulos para negociação, foram registrados pelo valor de aquisição e ajustados, diariamente, ao valor de mercado, conforme normas da Comissão de Valores Mobiliários. Os rendimentos e ganhos dos títulos que compõem a carteira do Fundo não sofrem retenção do imposto de renda na fonte.

Ativos mantidos até o vencimento – Incluem os ativos financeiros, exceto ações não resgatáveis, para os quais haja a intenção e a capacidade financeira para mantê-los até o vencimento, sendo contabilizados pelo custo de aquisição, acrescidos dos rendimentos intrínsecos e deduzidos de provisão para perda se considerada permanente.

4 Gerenciamento de riscos

a) Tipos de riscos

Risco de crédito

Consiste no risco de os emissores de ativos financeiros integrantes das carteiras nos quais o Fundo aplica seus recursos, por falta de capacidade financeira ou por indisposição, não honrarem o compromisso de pagar o principal ou qualquer parcela de juros de sua dívida.

Os títulos privados, quando constantes da carteira do Fundo são avaliados por comitê interno, devendo pertencer à categoria “baixo risco de crédito”, mediante ratings atribuídos por agências classificadoras de risco especializadas.

Risco de mercado

Com objetivo de minimizar riscos, a política de aquisição de ativos é aprovada por um comitê de investimento, que baseia suas decisões nas escolas de análises técnica e fundamentalista, buscando acompanhar as possíveis oscilações de mercado. Derivativos podem ser utilizados com objetivo de hedge e/ou assunção de riscos de mercado de acordo com a política de investimento do Fundo, a critério da Administradora.

**MB MATIC RENDA FIXA LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO
FINANCEIRO**

(CNPJ 04.570.232/0001-36)

(Administrado pela Mercantil do Brasil Corretora S.A. – CTVM)

(CNPJ 16.683.062/0001-85)

**Notas explicativas da Administradora às demonstrações
financeiras em 31 de dezembro de 2022 e de 2021**

Em milhares de reais, exceto quando indicado de outra forma

Para efeito de gerenciamento de risco de mercado, o Fundo utilizou os seguintes instrumentos: *Var – Value At Risk* (valor em risco) por ativos que compõem a carteira, calculado pelo modelo paramétrico. Esta metodologia consiste em mensurar o valor máximo que o Fundo poderá perder em um dia, dada uma oscilação dos preços de mercado, em condições de normalidade. *Stress Testing*: mede o impacto no resultado de uma carteira, em determinado cenário de anormalidade de mercado ou volatilidade.

Risco de liquidez

A administração da liquidez é diária e considera a concentração de investidores no Fundo e a liquidez dos negócios com ativos da carteira.

Os métodos utilizados para gerenciar os riscos aos quais o Fundo se encontra sujeito, não consistem garantia contra eventuais perdas patrimoniais que possam ser incorridas pelo Fundo.

Risco Legal

É o risco decorrente de decisões judiciais e/ou regulamentares que afetem o retorno esperado para os ativos da carteira.

Risco Sistemico

Risco proveniente de alterações econômicas de forma generalizada afetando todos os investimentos.

As condições econômicas nacionais e internacionais podem afetar o mercado resultando em alterações nas taxas de juros e câmbio, nos preços dos papéis e nos ativos em geral. Tais variações podem afetar o desempenho do Fundo.

Risco de Derivativos

Risco proveniente de perda em decorrência de eventual insuficiência de “*hedge*” ou por variações bruscas no preço dos ativos em momentos de nervosismo do mercado.

Análise de sensibilidade

Data de Referência	31.12.2022
Patrimônio Líquido	1.934
VAR / PL :	0,01%

Metodologia:

VaR Paramétrico - 95% de intervalo de confiança - Horizonte de tempo de 1 dia - Decaimento (EWMA) de 0.94.

A finalidade da mensuração dos riscos de mercado é a avaliação potenciais perdas decorrentes das variações de preços e taxas do mercado financeiro.

O método Value-at-Risk – Var (Valor em Risco) representa a perda máxima esperada para 1 dia com 95% de confiança.

Este método assume que os retornos dos ativos são relacionados linearmente com os retornos dos fatores de risco e que os fatores de risco são distribuídos normalmente.

MB MATIC RENDA FIXA LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO

(CNPJ 04.570.232/0001-36)

(Administrado pela Mercantil do Brasil Corretora S.A. – CTVM)

(CNPJ 16.683.062/0001-85)

**Notas explicativas da Administradora às demonstrações
financeiras em 31 de dezembro de 2022 e de 2021**

Em milhares de reais, exceto quando indicado de outra forma

O cálculo do VaR é um método estatístico podendo subestimar as perdas resultantes do aumento futuro da volatilidade dos ativos, e, conseqüentemente, podem ocorrer perdas maiores do que as previstas em decorrência das flutuações de mercado.

5 Destinação dos resultados

Os resultados apurados foram incorporados ao patrimônio líquido do Fundo sem emissão de novas cotas.

6 Taxas e encargos

A taxa de administração é calculada e contabilizada diariamente à razão de 0,50% a.a. sobre o valor do patrimônio líquido do Fundo, como somatório das remunerações devidas pelos serviços de administração que compreendem gestão da carteira, atividades de tesouraria, de controle e processamento de títulos e valores mobiliários, escrituração, emissão e resgate de cotas, sendo o pagamento efetuado mensalmente a Administradora. Os encargos debitados ao Fundo e respectivos percentuais em relação ao patrimônio líquido médio são os seguintes:

	Taxa de Administração		Outras Despesas	
	R\$	%	R\$	%
31 de dezembro de 2022	11	0,57	22	1,14
31 de dezembro de 2021	12	0,52	35	1,51

O Fundo não cobra taxa de performance, de ingresso ou de saída.

7 Gestão e Custódia de títulos

A gestão da carteira e a tesouraria do Fundo é exercida pela própria Administradora. Os títulos e valores mobiliários estão custodiados quando aplicável junto à Sistema Especial de Liquidação e Custódia – SELIC e na B3 S.A. - Brasil, Bolsa, Balcão.

8 Rentabilidade

O valor da cota, a rentabilidade e o patrimônio líquido médio registrados são como seguem:

Exercícios findos em 31 de dezembro de	Valor da Cota	Rentabilidade	Patrimônio Líquido Médio	Variação do CDI
2022	124,1100299	11,34%	2.267	12,35%
2021	111,4695754	11,42%	2.320	4,40%

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de resultados futuros.

9 Emissão e resgate de cotas

Para fins de emissão de cotas pelo Fundo é utilizado o valor da cota em vigor no dia da efetiva disponibilidade de recursos, confiados pelo cotista em favor da Administradora em sua sede. Os resgates são processados com base no valor da cota apurado no dia do recebimento da solicitação na sede da Administradora ou nas agências do Banco Mercantil do Brasil S.A. O pagamento do resgate é efetuado por meio de cheque, crédito em conta corrente ou ordem de pagamento, sem cobrança de qualquer taxa ou despesa, no dia do recebimento da solicitação.

**MB MATIC RENDA FIXA LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO
FINANCEIRO**

(CNPJ 04.570.232/0001-36)

(Administrado pela Mercantil do Brasil Corretora S.A. – CTVM)

(CNPJ 16.683.062/0001-85)

**Notas explicativas da Administradora às demonstrações
financeiras em 31 de dezembro de 2022 e de 2021**

Em milhares de reais, exceto quando indicado de outra forma

10 Tributos:

A retenção do imposto de renda ocorrerá no último dia útil dos meses de maio e novembro de cada ano, ou no resgate de cotas, se ocorrido em data anterior e estarão sujeitos às alíquotas decrescentes demonstradas abaixo:

<u>Prazo de aplicação</u>	<u>Alíquota (%)</u>
Até 6 meses	22,50
De 6 a 12 meses	20,00
De 12 a 24 meses	17,50
Acima de 24 meses	15,00

Caso por qualquer razão a carteira do Fundo apresentar características de curto prazo, o imposto de renda retido na fonte incidentes sobre o rendimento das cotas será de:

<u>Prazo de aplicação</u>	<u>Alíquota (%)</u>
Até 6 meses	22,50
Acima de 6 meses	20,00

O IOF será de 1% (um por cento) ao dia sobre o valor do resgate, limitado a um percentual do rendimento da operação, decrescente em função do prazo de aplicação. Para os resgates efetuados a partir do trigésimo dia da data da aplicação, não haverá cobrança deste IOF.

Os cotistas isentos, os imunes e os amparados por norma legal ou medida judicial específicas não sofrem retenção do imposto de renda na fonte e ou IOF.

11 Política de divulgação de informações

A Administradora remete mensalmente o extrato da conta de aplicação no Fundo e diariamente disponibiliza em sua sede, nas agências do Banco Mercantil do Brasil S.A., o valor da cota, rentabilidade e patrimônio líquido. Informações complementares poderão ser encontradas no site da instituição.

12 Instrumentos Financeiros Derivativos

O Fundo não contratou operações com derivativos financeiros durante os exercícios findos em 31 de dezembro de 2022 e de 2021.

13 Partes Relacionadas

- a) As operações compromissadas do Fundo tem como contraparte o Banco Mercantil do Brasil S.A., sendo realizadas em condições de mercado no que se relaciona a prazos e taxas praticadas:

Operações Compromissadas com Partes Relacionadas			
Mês/Ano	Operações Compromissadas Realizadas com Partes Relacionadas/Total de Operações Compromissadas	Volume Médio Diário / Patrimônio Médio Diário do Fundo	Taxa Média Contratada/Taxa SELIC
Jan-2022	100,00%	16,64%	100,00%
Fev-2022	100,00%	16,37%	100,00%
Mar-2022	100,00%	24,81%	100,00%

**MB MATIC RENDA FIXA LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO
FINANCEIRO**

(CNPJ 04.570.232/0001-36)

(Administrado pela Mercantil do Brasil Corretora S.A. – CTVM)

(CNPJ 16.683.062/0001-85)

Notas explicativas da Administradora às demonstrações

financeiras em 31 de dezembro de 2022 e de 2021

Em milhares de reais, exceto quando indicado de outra forma

Operações Compromissadas com Partes Relacionadas			
Mês/Ano	Operações Compromissadas Realizadas com Partes Relacionadas/Total de Operações Compromissadas	Volume Médio Diário / Patrimônio Médio Diário do Fundo	Taxa Média Contratada/Taxa SELIC
Abr-2022	100,00%	19,01%	100,00%
Mai-2022	100,00%	20,03%	100,00%
Jun-2022	100,00%	23,26%	100,00%
Jul-2022	100,00%	21,77%	100,00%
Ago-2022	100,00%	10,09%	100,00%
Set-2022	100,00%	34,31%	100,00%
Out-2022	100,00%	34,08%	100,00%
Nov-2022	100,00%	34,38%	100,00%
Dez-2022	100,00%	19,33%	100,00%

- b) As operações de compra e venda definitivas de títulos públicos federais do Fundo tem como contraparte o Banco Mercantil do Brasil S.A., sendo realizadas em condições de mercado no que se relaciona a prazos e taxas praticadas:

Operações de Compra e Venda Definitivas de Títulos Públicos Federais Realizadas com Partes Relacionadas			
Mês/Ano	Operações Definitivas de Compra e Venda de Títulos Públicos Federais Realizadas com Partes Relacionadas/Total de Operações Definitivas com Títulos Públicos Federais	Volume Médio Diário / Patrimônio Médio Diário do Fundo	(Preço Praticado/Preço Médio do Dia*) Ponderado pelo Volume (*) PU SELIC
Mar-2022	100,00%	9,04%	100,00%
Jul-2022	100,00%	7,58%	99,95%
Ago-2022	100,00%	8,52%	99,95%
Set-2022	100,00%	13,47%	100,00%
Dez-2022	100,00%	10,59%	99,95%

Em 31 de dezembro de 2022, o Fundo, além de parte da Diretoria do Grupo, possui os seguintes saldos com partes relacionadas à Administradora do Fundo:

- Disponibilidade.....R\$	16 (Ativo)
- Operações Compromissadas.....R\$	278 (Ativo)
- Títulos Privados.....R\$	305 (Ativo)
- Taxa de Administração.....R\$	11 (Resultado)

14 Demandas Judiciais

Não há registro de demandas judiciais, quer na defesa dos direitos dos cotistas, quer desses contra a administração do Fundo.

15 Alterações Estatutárias

Não houve alterações estatutárias no exercício findo em 31 de dezembro de 2022.

**MB MATIC RENDA FIXA LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO
FINANCEIRO**

(CNPJ 04.570.232/0001-36)

(Administrado pela Mercantil do Brasil Corretora S.A. – CTVM)

(CNPJ 16.683.062/0001-85)

**Notas explicativas da Administradora às demonstrações
financeiras em 31 de dezembro de 2022 e de 2021**

Em milhares de reais, exceto quando indicado de outra forma

16 Outros assuntos

A Comissão de Valores Mobiliários (CVM) publicou em 23 de dezembro de 2022 a Resolução CVM nº175, que dispõe sobre a constituição, o funcionamento e a divulgação de informações dos fundos de investimento, bem como sobre a prestação de serviços para os fundos de investimentos. A referida Resolução, que revoga algumas normas aplicáveis aos fundos de investimento atualmente vigentes, entrará parcialmente em vigor em 02 de outubro de 2023, uma vez que alguns de seus dispositivos entrarão em vigor em datas posteriores, conforme especificado na nova Resolução.

O Administrador está em processo de avaliação das eventuais adequações necessárias para o pleno atendimento da norma no prazo determinado pelo regulador. Para a data-base dessas demonstrações contábeis, não há impactos decorrentes da publicação da nova Resolução.

17 Outras informações

A Administradora não contratou para o Fundo outros serviços com o auditor independente, responsável pelo exame das demonstrações contábeis do Fundo, que não seja o de auditoria independente.

18 Informações adicionais

Em 2021 os mercados financeiros e de capitais foram fortemente atingidos pelos efeitos da pandemia provocada com o surgimento do COVID-19. A partir de meados de fevereiro e conforme foram aumentando os casos da doença mundo afora a cotação do dólar se elevou consideravelmente frente ao Real, as taxas de juros prefixadas se estressaram e o índice da B3 que mede o desempenho das principais ações negociadas mergulhou do patamar de 120 mil pontos para 62 mil pontos, rapidamente. Tudo isso, teve impacto negativo significativo na marcação a mercados dos fundos de renda fixa, multimercados e de renda variável. Contudo, a partir de meados de agosto e início de setembro com o início da inversão da curva de infecção pela doença os mercados foram retornando à normalidade com boa recuperação do Ibovespa e redução da volatilidade dos juros e consequentemente aliviando os efeitos sobre a marcação a mercado dos fundos de investimentos.

Em 2022, os efeitos da pandemia se arrefeceram de forma considerável, a não ser por alguns reflexos negativos provocados pela rígida política do Covid Zero imposta pela China, o maior comprador de commodities brasileiras a nível mundial. Ainda assim, a economia se recuperou satisfatoriamente expressa pelo pujante crescimento do PIB, muito próximo de 3,0%, a se ainda divulgado. Por outro lado, a inflação se mostrou muito resiliente levando o Banco Central a persistir na elevação da taxa básica Selic para o patamar de 13,75% ao ano, no encerramento do exercício.

Nesse contexto, os fundos de renda fixa posicionados em taxa pós e os multimercado menos sujeito ao risco variável foram bastante favorecidos. Em contrapartida, os fundos posicionados em taxas prefixadas assim como os fundos de ações tiveram suas performances prejudicadas pelos efeitos da marcação a mercado e pelo desempenho das ações, respectivamente. No exercício o Ibovespa que mede a rentabilidade das ações mais líquidas negociadas na B3, apresentou uma variação positiva de 4,68%.

ATHAÍDE VIEIRA DOS SANTOS
Diretor-Presidente

JOSÉ MARIA RIBEIRO DE MELO
Diretor

CARLOS ALBERTO GOMES DE OLIVEIRA
Contador CRC - MG 042672/O-7