

Fundo de Investimento Caixa Multimercado RV 30 Longo Prazo

CNPJ: 03.737.188/0001-43
(Administrado pela Caixa Econômica Federal)
(CNPJ: 00.360.305/0001-04)

**Demonstrações contábeis em 30
de junho de 2021**

Conteúdo

Relatório dos auditores independentes sobre as demonstrações contábeis	3
Demonstrativo da composição e diversificação da carteira	7
Demonstrações das evoluções do patrimônio líquido	8
Notas explicativas às demonstrações contábeis	9
Anexo - Demonstrativo das evoluções do valor da cota e patrimônio líquido médio	21



KPMG Auditores Independentes Ltda.
Rua Arquiteto Olavo Redig de Campos, 105, 6º andar - Torre A
04711-904 - São Paulo/SP - Brasil
Caixa Postal 79518 - CEP 04707-970 - São Paulo/SP - Brasil
Telefone +55 (11) 3940-1500
kpmg.com.br

Relatório dos auditores independentes sobre as demonstrações contábeis

Aos Cotistas e à Administradora do
Fundo de Investimento Caixa Multimercado RV 30 Longo Prazo
São Paulo - SP

Opinião

Examinamos as demonstrações contábeis do Fundo de Investimento Caixa Multimercado RV 30 Longo Prazo ("Fundo"), administrado pela Caixa Econômica Federal, que compreendem o demonstrativo da composição e diversificação da carteira em 30 de junho de 2021 e as respectivas demonstrações das evoluções do patrimônio líquido para o exercício findo nessa data, bem como as correspondentes notas explicativas, compreendendo as políticas contábeis significativas e outras informações elucidativas.

Em nossa opinião, as demonstrações contábeis acima referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do Fundo em 30 de junho de 2021 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 nº 555/14 da Comissão de Valores Mobiliários ("CVM").

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 dos auditores pela auditoria das demonstrações contábeis". 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 corrente. Esses assuntos foram tratados no contexto de nossa auditoria das demonstrações contábeis como um todo e na



formação de nossa opinião sobre essas demonstrações contábeis e, portanto, não expressamos uma opinião separada sobre esses assuntos.

Custódia e valorização de ativos financeiros

Em 30 de junho de 2021, o Fundo possuía 97,87% do seu patrimônio líquido representado por aplicações em títulos públicos e aplicações interfinanceiras de liquidez mensurados ao valor justo que são ativamente negociados e para os quais os preços e indexadores/parâmetros são observáveis no mercado, registrados e custodiados em órgão regulamentado de liquidação e custódia (Sistema Especial de Liquidação e Custódia – SELIC). Devido ao fato desses ativos serem os principais elementos que influenciam o patrimônio líquido e o reconhecimento de resultado do Fundo, no contexto das demonstrações contábeis como um todo, consideramos esse assunto significativo em nossa auditoria.

Como nossa auditoria conduziu esse assunto

Os nossos procedimentos de auditoria incluíram, mas não estão limitados a:

- Teste de existência por meio de conciliação das posições mantidas pelo Fundo com as informações fornecidas pelo custodiante;
- Com auxílio de nossos especialistas em instrumentos financeiros, recalculamos a valorização dos ativos financeiros com base em preços disponíveis obtidos junto a fontes de mercado independentes ou informações observáveis no mercado;
- Avaliamos a rentabilidade obtida pelo Fundo auditado por meio da comparação do seu resultado com o resultado esperado considerando os ativos investidos; e
- Avaliação das divulgações efetuadas nas demonstrações contábeis do Fundo.

Com base nas evidências obtidas por meio dos procedimentos acima resumidos, consideramos aceitáveis os critérios utilizados para validar a existência e valorização das aplicações em títulos públicos e aplicações interfinanceiras de liquidez, assim como as divulgações relacionadas, no contexto das demonstrações contábeis tomadas em conjunto, referentes ao exercício findo em 30 de junho de 2021.

Reconhecimento do resultado com instrumentos financeiros derivativos

Conforme descrito na nota explicativa nº 1, o Fundo utiliza estratégias com derivativos como parte de sua política de investimentos, para proteção das posições detidas à vista e posicionamento limitado a uma vez seu patrimônio líquido, vedado à alavancagem. Durante o exercício findo em 30 de junho de 2021, o Fundo efetuou operações com instrumentos financeiros derivativos, que geraram resultado líquido positivo de R\$ 165.032 mil. Devido à relevância do resultado destas operações, no contexto das demonstrações contábeis tomadas em conjunto, esse assunto foi considerado como significativo para nossa auditoria.

Como nossa auditoria conduziu esse assunto:

Os nossos procedimentos de auditoria incluíram, mas não estão limitados a:



- Teste da liquidação financeira de transações com instrumentos financeiros derivativos realizadas durante o exercício;
- Avaliação das divulgações efetuadas nas demonstrações contábeis do Fundo.

Com base nas evidências obtidas por meio dos procedimentos acima resumidos, consideramos aceitáveis os critérios utilizados para validar os resultados de ganhos e perdas com instrumentos financeiros derivativos, assim como as divulgações relacionadas, no contexto das demonstrações financeiras tomadas em conjunto, referentes ao exercício findo em 30 de junho de 2021.

Outras informações que acompanham as demonstrações contábeis e o relatório dos auditores

A administração do Fundo é responsável por essas outras informações que compreendem o demonstrativo das evoluções do valor da cota e patrimônio líquido médio.

Nossa opinião sobre as demonstrações contábeis não abrange o demonstrativo das evoluções do valor da cota e patrimônio líquido médio, e não expressamos qualquer forma de conclusão de auditoria sobre esse demonstrativo.

Em conexão com a auditoria das demonstrações contábeis, nossa responsabilidade é a de ler o demonstrativo das evoluções do valor da cota e patrimônio líquido médio e, ao fazê-lo, considerar se esse demonstrativo está, de forma relevante, inconsistente com as demonstrações contábeis ou com nosso conhecimento obtido na auditoria ou, de outra forma, aparenta estar distorcido de forma relevante. Se, com base no trabalho realizado, concluirmos que há distorção relevante no demonstrativo das evoluções do valor da cota e patrimônio líquido médio, somos requeridos a comunicar esse fato. Não temos nada a relatar a este respeito.

Responsabilidade da administração do Fundo pelas demonstrações contábeis

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

Na elaboração das demonstrações contábeis, a administração é responsável, dentro das prerrogativas previstas na Instrução nº 555/14 da CVM, pela avaliação da capacidade de o Fundo continuar operando, divulgando, quando aplicável, os assuntos relacionados com a sua continuidade operacional e o uso dessa base contábil na elaboração das demonstrações contábeis, a não ser que a administração pretenda liquidar o Fundo ou cessar suas operações, ou não tenha nenhuma alternativa realista para evitar o encerramento das operações.

Responsabilidades dos auditores pela auditoria das demonstrações contábeis



Nossos objetivos são obter segurança razoável de que as demonstrações contábeis, 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 dos usuários tomadas com base nas referidas demonstrações contábeis.

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 contábeis, 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.
- Obtemos 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 da administradora do Fundo.
- Avaliamos a adequação das políticas contábeis utilizadas e a razoabilidade das estimativas contábeis e respectivas divulgações feitas pela Administradora.
- Concluimos sobre a adequação do uso, pela administração, 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 contábeis 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 contábeis, inclusive as divulgações e se as demonstrações contábeis 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 a Administradora, determinamos aqueles que foram considerados como mais significativos na auditoria das demonstrações contábeis do exercício corrente 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, 28 de setembro de 2021

KPMG Auditores Independentes
CRC 2SP014428/O-6

Rodrigo Cruz Bassi
Contador CRC 1SP261156/O-7

Demonstrativo da Composição e Diversificação da Carteira

Mês/Ano: 30 de junho de 2021

Nome do Fundo: Fundo de Investimento Caixa Multimercado RV 30 Longo Prazo

CNPJ: 03.737.188/0001-43

Administradora: Caixa Econômica Federal

CNPJ: 00.360.305/0001-04

Aplicações - Especificações	Espécie / Forma	Quantidade	Cotação por lote de mil ou preço unitário – R\$	Custo Total R\$ mil	Mercado / Realização R\$ mil	% sobre o patrimônio líquido
Disponibilidades					1	-
Banco conta movimento					1	-
Aplicações Interfinanceiras de liquidez				420.384	420.384	21,03
Letras do Tesouro Nacional		490.009		420.384	420.384	21,03
Títulos públicos				1.550.435	1.535.812	76,84
Letras Financeiras do Tesouro		142.204		1.546.500	1.531.877	76,64
Notas do Tesouro Nacional - Série B		906		3.935	3.935	0,20
Ações				35.516	41.524	2,08
Caixa Seguridade Participações S.A. (a)	ON	1.057.000	13,07	10.221	13.815	0,69
Vale S.A.	ON	92.000	113,25	8.914	10.419	0,52
BTG Pactual Participations. Ltd.	UNT	58.300	122,06	6.034	7.116	0,36
Itaú Unibanco Holding S.A.	PN	234.000	29,80	7.017	6.973	0,35
Petro Rio S.A.	ON	164.240	19,49	3.330	3.201	0,16
Despesas Antecipadas					1	-
Taxa ANBIMA					1	-
Valores a receber					10.213	0,51
Ações a liquidar					9.492	0,48
Diferencial Swap					395	0,02
Ajuste diário de futuros					217	0,01
Prêmio de Opções - Ações					72	-
Dividendos e bonificações					27	-
Juros sobre capital próprio					10	-
Total do ativo					2.007.935	100,46
Valores a pagar					9.106	0,46
Cotas a Resgatar					3.895	0,20
Ajuste diário de futuros					2.585	0,13
Taxa de Administração					1.666	0,08
Diferencial Swap					742	0,04
Prêmio de Opções - Ações					124	0,01
Auditoria e Custódia					52	-
Fiscais e previdenciárias					37	-
Comissões e Corretagens					4	-
Ações a liquidar					1	-
Patrimônio líquido					1.998.829	100,00
Total do passivo e Patrimônio líquido					2.007.935	100,46

(a) Títulos de emissão de empresas ligadas à Administradora.

As notas explicativas são parte integrante das demonstrações contábeis.

Demonstrações da Evoluções do Patrimônio Líquido

Exercícios findos em 30 de junho de 2021 e de 2020

Nome do Fundo:	Fundo de Investimento Caixa Multimercado RV 30 Longo Prazo	CNPJ:	03.737.188/0001-43
Administradora:	Caixa Econômica Federal	CNPJ:	00.360.305/0001-04

Valores em R\$ 1.000, exceto o valor unitário das cotas

	2021	2020
Patrimônio líquido no início dos exercícios		
Representado por 318.406.496,424 cotas a R\$ 7,514548 cada	2.392.681	
Representado por 107.160.676,126 cotas a R\$ 7,252423 cada		777.175
Cotas emitidas nos exercícios		
65.212.751,904 cotas	505.752	
408.573.034,263 cotas		3.152.461
Cotas resgatadas nos exercícios		
137.851.031,780 cotas	(1.019.688)	
197.327.213,965 cotas		(1.411.166)
Varição no resgate de cotas nos exercícios	(61.110)	(25.147)
Patrimônio líquido antes dos resultados	1.817.635	2.493.323
Resultado dos exercícios		
Ações	875	(3.683)
Dividendos e juros sobre capital próprio	612	74
Resultado nas negociações	(5.745)	(1.271)
Valorização/desvalorização a preço de mercado	6.008	(2.486)
Cotas de fundos	3.618	(3.744)
Rendas/despesas de aplicação em cotas de fundos de investimento	3.618	(3.744)
Renda fixa e outros ativos financeiros	35.277	72.683
Apropriação de rendimentos	49.870	73.937
Resultado nas negociações	30	(10)
Desvalorização a preço de mercado	(14.623)	(1.244)
Demais receitas	891.718	1.293.381
Ganhos com derivativos	891.718	1.293.381
Demais despesas	(750.294)	(1.459.279)
Auditoria e custódia	(617)	(481)
Corretagens e taxas	(693)	(818)
Despesas diversas	(131)	(158)
Perdas com derivativos	(726.686)	(1.439.695)
Publicações e correspondências	(8)	(7)
Remuneração da administração	(22.090)	(18.057)
Serviços contratados pelo fundo	(1)	(1)
Taxa de fiscalização CVM	(68)	(62)
Total do resultado dos exercícios	181.194	(100.642)
Patrimônio líquido no final dos exercícios		
Representado por 245.768.216,548 cotas a R\$ 8,132985 cada	1.998.829	
Representado por 318.406.496,424 cotas a R\$ 7,514548 cada		2.392.681

As notas explicativas são parte integrante das demonstrações contábeis.

Fundo de Investimento Caixa Multimercado RV 30 Longo Prazo

CNPJ: 03.737.188/0001-43

(Administrado pela Caixa Econômica Federal)

Notas explicativas às demonstrações contábeis

Exercícios findos em 30 de junho de 2021 e de 2020

Em milhares de Reais, exceto quando especificado

1 Contexto operacional

O Fundo de Investimento Caixa Multimercado RV 30 Longo Prazo ("Fundo") foi constituído sob a forma de condomínio aberto, iniciou suas atividades em 20 de junho de 2000, com prazo indeterminado de duração. Destina-se a acolher investimentos de pessoas físicas e jurídicas e tem por objetivo proporcionar ao cotista a valorização de suas cotas por meio da aplicação dos recursos em carteira diversificada de ativos financeiros, no âmbito do mercado financeiro e de capitais nacional e internacional, não constituído, em qualquer hipótese, garantia ou promessa de rentabilidade por parte da Administradora.

Os ativos que compõem a carteira do Fundo e/ou dos fundos investidos estarão expostos diretamente, ou através do uso de derivativos, em posições ativas e/ou passivas, aos riscos das variações das taxas de juros prefixadas ou pós-fixadas (SELIC/CDI), índices de inflação e/ou preços, commodities, variação cambial e de preços das ações ou índices do mercado acionário ou todos, não havendo, necessariamente, um fator de risco principal.

O Fundo utiliza instrumentos de derivativos para proteção das posições detidas à vista e posicionamento limitado a uma vez seu patrimônio líquido, vedado à alavancagem.

Consequentemente, as cotas do Fundo estão sujeitas às oscilações positivas e negativas de acordo com os ativos integrantes de sua carteira, podendo levar inclusive à perda do capital investido.

As aplicações em Fundo não são garantidas pela Administradora, Gestora, de qualquer mecanismo de seguro ou ainda pelo Fundo Garantidor de Crédito (FGC).

A gestão da carteira do Fundo é realizada pela Administradora.

2 Apresentação e elaboração das demonstrações contábeis

As demonstrações contábeis são elaboradas de acordo com as práticas contábeis aplicáveis aos fundos de investimento, complementadas pelas normas previstas no Plano Contábil dos Fundos de Investimento (COFI) e pelas orientações emanadas da Comissão de Valores Mobiliários (CVM).

As demonstrações contábeis 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 auferidos poderão ser diferentes dos estimados.

3 Práticas contábeis

Entre as principais práticas contábeis adotadas destacam-se:

(a) Reconhecimento de receitas e despesas

A Administradora adota o regime de competência para o registro das receitas e despesas.

Fundo de Investimento Caixa Multimercado RV 30 Longo Prazo

CNPJ: 03.737.188/0001-43

(Administrado pela Caixa Econômica Federal)

Notas explicativas às demonstrações contábeis

Exercícios findos em 30 de junho de 2021 e de 2020

Em milhares de Reais, exceto quando especificado

(b) Aplicações interfinanceiras de liquidez

As operações compromissadas são registradas pelo valor efetivamente pago e atualizadas diariamente pelo rendimento auferido com base na taxa de remuneração e por se tratar de operações de curto prazo, o custo atualizado está próximo ao seu valor de mercado.

(c) Cotas de fundos de índice

As cotas de fundos de índice integrantes da carteira são registradas pelo custo médio de aquisição (custo) e valorizadas pela cotação de fechamento do último dia em que foram negociadas em bolsas de valores.

(d) Corretagens - Fundos de Índice

As despesas de corretagens em operações de compra de cotas de fundos de índice são consideradas parte integrante do custo de aquisição. Na venda são registradas como despesa, na conta de "Corretagens e taxas".

(e) Títulos de renda fixa

Os títulos de renda fixa integrantes da carteira são contabilizados pelo custo de aquisição, acrescido diariamente dos rendimentos incorridos (curva) até a data do balanço e ajustados ao valor de mercado em função da classificação dos títulos - Nota Explicativa nº 4.

(f) Ações negociadas no Brasil

As ações integrantes da carteira foram registradas pelo custo médio de aquisição (custo) e valorizadas pela cotação de fechamento do último dia em que foram negociadas em bolsas de valores.

(g) Bonificações

As bonificações foram registradas na carteira de títulos pelas respectivas quantidades, sem modificações do valor dos investimentos e, quando as ações foram consideradas como "ex-direito" nas bolsas de valores foram avaliadas conforme acima.

(h) Dividendos/Juros sobre capital próprio

Foram reconhecidos em resultado quando as ações correspondentes são consideradas "ex-direito" nas bolsas de valores.

(i) Corretagens

As despesas de corretagens em operações de compra de ações foram consideradas parte integrante do custo de aquisição. Na venda foram registradas como despesa, na conta de "Despesa com corretagens e taxas".

(j) Operações de "swap"

As receitas e despesas provenientes do diferencial a receber e a pagar nas operações de "Swap", ajustadas a mercado são registradas diariamente na rubrica "Ganhos com derivativos/Perdas com derivativos".

(k) Mercado futuro

Fundo de Investimento Caixa Multimercado RV 30 Longo Prazo

CNPJ: 03.737.188/0001-43

(Administrado pela Caixa Econômica Federal)

Notas explicativas às demonstrações contábeis

Exercícios findos em 30 de junho de 2021 e de 2020

Em milhares de Reais, exceto quando especificado

Os contratos de operações realizadas no mercado futuro de ativos financeiros e mercadorias são ajustados diariamente pela variação das cotações divulgadas pela B3 S.A. – Brasil, Bolsa, Balcão. Os ajustes a mercado desses contratos são apurados diariamente por tipo e respectivo vencimento e reconhecidos em lucros ou prejuízos com ativos financeiros e mercadorias, componentes de “Ganhos com derivativos” e “Perdas com derivativos”.

(l) Opções padronizadas

As operações com opções são atualizadas diariamente com base nos preços divulgados pelas bolsas de valores, onde as operações são custodiadas, e seus resultados, são registrados nas rubricas “Ganhos com derivativos/Perdas com derivativos”.

(m) Corretagens

As despesas de corretagens em operações de compra de ações e instrumentos financeiros de derivativos foram consideradas parte integrante do custo de aquisição. Na venda foram registradas como despesa, na conta de “Corretagens e taxas”.

4 Ativos financeiros

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

- (i) **Títulos para negociação:** incluem os ativos financeiros adquiridos com o objetivo de serem negociados frequentemente e de forma ativa, sendo registrados pelo custo de aquisição, acrescidos dos rendimentos e avaliados diariamente pelo valor de mercado, em que as perdas e os ganhos realizados e não realizados sobre esses títulos são reconhecidos no resultado;

Composição da carteira

Os ativos financeiros integrantes da carteira e suas respectivas faixas de vencimento estão assim classificados:

Fundo de Investimento Caixa Multimercado RV 30 Longo Prazo

CNPJ: 03.737.188/0001-43

(Administrado pela Caixa Econômica Federal)

Notas explicativas às demonstrações contábeis

Exercícios findos em 30 de junho de 2021 e de 2020

Em milhares de Reais, exceto quando especificado

Títulos para negociação	Custo atualizado	Valor de Mercado/ realização	Ajuste a Valor de Mercado	Faixas de vencimento
Títulos de emissão do Tesouro Nacional:				
Notas do Tesouro Nacional - Série B	3.935	3.935	-	Após 1 ano
Letras Financeiras do Tesouro	14.883	14.875	(8)	Até 1 ano
Letras Financeiras do Tesouro	1.531.617	1.517.002	(14.615)	Após 1 ano
	1.550.435	1.535.812	(14.623)	
Total dos títulos para negociação:	1.550.435	1.535.812	(14.623)	

O Fundo mantém, também em sua carteira ações de companhias abertas no valor de R\$ 41.524.

Valor de mercado

Os critérios utilizados para apuração do valor de mercado são os seguintes:

Títulos de renda fixa

Títulos públicos

- **Pós-fixados:** As LFT's são atualizadas pelas cotações/taxas divulgadas nos boletins publicados pela ANBIMA. Para as NTN's, é utilizado o fluxo de caixa descontado. As taxas de desconto/indexadores utilizados são cotações/taxas divulgadas por boletins ou publicações especializadas (ANBIMA).

5 Valorização/Desvalorização de investimentos a preço de mercado - Renda Fixa

Renda Fixa

Refere-se ao diferencial do valor de curva e de mercado para os títulos existentes na carteira na data do balanço no valor de R\$ (14.623) (R\$ (1.244) em 2020) para renda fixa e outros ativos financeiros e registrados na rubrica "Desvalorização a preço de mercado". Para os títulos negociados no exercício os diferenciais a mercado compõem o resultado realizado no exercício e são refletidos na conta "Resultado nas negociações".

Ações

Refere-se ao diferencial entre o custo médio de aquisição (atualizado a valor de mercado na data do último balanço) e seu valor de mercado, no valor de R\$ 6.008 (R\$ (2.486) em 2020) registrados na conta "Valorização/desvalorização a preço de mercado". Para os títulos negociados no exercício, os diferenciais a mercado compõem o resultado realizado no exercício e são refletidos na conta

Fundo de Investimento Caixa Multimercado RV 30 Longo Prazo

CNPJ: 03.737.188/0001-43

(Administrado pela Caixa Econômica Federal)

Notas explicativas às demonstrações contábeis

Exercícios findos em 30 de junho de 2021 e de 2020

Em milhares de Reais, exceto quando especificado

“Resultado nas negociações”.

6 Margem de garantia

No Exercício findo em 30 de junho de 2021, o Fundo possui margem depositada em garantia para realização de operações com derivativos, representada conforme abaixo:

Tipo	Quantidade	Vencimento	Valor
Letra Financeira do Tesouro	180	01/09/2022	1.959
Letra Financeira do Tesouro	2	01/09/2021	22
Letra Financeira do Tesouro	11.865	01/03/2026	127.631
Letra Financeira do Tesouro	230	01/03/2023	2.501
Letra Financeira do Tesouro	1.213	01/09/2024	13.120
Letra Financeira do Tesouro	2.853	01/03/2024	30.902

Fundo de Investimento Caixa Multimercado RV 30 Longo Prazo

CNPJ: 03.737.188/0001-43

(Administrado pela Caixa Econômica Federal)

Notas explicativas às demonstrações contábeis

Exercícios findos em 30 de junho de 2021 e de 2020

Em milhares de Reais, exceto quando especificado

7 Instrumentos financeiros derivativos

As operações com instrumentos financeiros derivativos são realizadas em bolsa e seus valores assim como seus prazos de vencimento estão demonstrados conforme segue:

(a) Composição da carteira

Futuros

Quantidade de contratos					
Indexador	Compra	Venda	Posição líquida	Valor referência	de Faixas de vencimento
FUT DAP	-	(13)	(13)	(1.112)	Após 1 ano
FUT DI1	385	-	385	20.508	Após 1 ano
FUT DI1	-	(874)	(874)	(75.700)	Após 1 ano
FUT CNH	-	(30)	(30)	(1.506)	Até 1 ano
FUT DI1	222	-	222	22.196	Até 1 ano
FUT DI1	-	(891)	(891)	(86.618)	Até 1 ano
FUT EUP	-	(74)	(74)	(4.379)	Até 1 ano
FUT IND	3.716	-	3.716	472.876	Até 1 ano
FUT ISP	8	-	8	8.570	Até 1 ano
FUT SEK	59	-	59	2.940	Até 1 ano
FUT T10	-	(72)	(72)	(47.721)	Até 1 ano
Total	4.390	(1.954)	2.436	310.054	

Os ajustes de futuros apresentados no Demonstrativo da Composição e Diversificação da Carteira, em 30 de junho de 2021, são os seguintes:

- Ajustes de futuros a receber - R\$ 217
- Ajustes de futuros a pagar - R\$ 2.585

Em 30 de junho de 2021, o resultado líquido com operações de futuros totaliza R\$ 165.941 (R\$ (147.444) em 2020), e seus valores brutos estão registrados em "Demais receitas-Ganhos com derivativos" e "Demais despesas - Perdas com derivativos".

Fundo de Investimento Caixa Multimercado RV 30 Longo Prazo

CNPJ: 03.737.188/0001-43

(Administrado pela Caixa Econômica Federal)

Notas explicativas às demonstrações contábeis

Exercícios findos em 30 de junho de 2021 e de 2020

Em milhares de Reais, exceto quando especificado

Swap

Contrato	Valor de referência	Valor atual	Posição líquida a receber/pagar
Até 1 ano			
Posição Ativa - CDI		87.086	
Posição Passiva - PRE 2,52% ao ano	85.000	87.283	(197)
Posição Ativa - PRE 2,89% ao ano		65.078	
Posição Passiva - CDI	63.055	64.683	395
Posição Ativa - PRE 2,97% ao ano		86.541	
Posição Passiva - CDI	85.000	87.086	(545)

Os ajustes de swap apresentados no Demonstrativo da Composição e Diversificação da Carteira, em 30 de junho de 2021, são os seguintes:

- Diferencial swap a pagar - R\$ 742
- Diferencial swap a receber - R\$ 395

Em 30 de junho de 2021, o resultado líquido com operações de swap totaliza R\$ (577) (R\$ 243 em 2020), e seus valores brutos estão registrados em "Demais receitas-Ganhos com derivativos" e "Demais despesas - Perdas com derivativos".

Opções de futuros

Em 30 de junho de 2021, não havia contratos em aberto de operações de opções de Futuros. O resultado líquido com operações de opções de futuros contratadas durante o exercício findo em 30 de junho de 2021 totaliza R\$ (420) (R\$ (80) em 2020), e seus valores brutos estão registrados em "Demais receitas-Ganhos com derivativos" e "Demais despesas - Perdas com derivativos".

Opções de ações

Tipo	Custo	Mercado	Resultado	Faixas de vencimento
Compra de opção de venda				
IBOV IBO	116	54	(62)	Até 1 ano
IBOV IBO	82	18	(64)	Até 1 ano
	198	72	(126)	
Venda de opção de compra				
IBOV IBO	(69)	(37)	33	Até 1 ano
IBOV IBO	(80)	(70)	10	Até 1 ano
	(149)	(107)	43	

Fundo de Investimento Caixa Multimercado RV 30 Longo Prazo

CNPJ: 03.737.188/0001-43

(Administrado pela Caixa Econômica Federal)

Notas explicativas às demonstrações contábeis

Exercícios findos em 30 de junho de 2021 e de 2020

Em milhares de Reais, exceto quando especificado

Venda de opção de venda			
IBOV IBO	(16)	(4)	12 Até 1 ano
IBOV IBO	(31)	(13)	18 Até 1 ano
	(47)	(17)	30
Total	2	(52)	(53)

O prêmio de opções de ações apresentado no Demonstrativo da Composição e Diversificação da Carteira, em 30 de junho de 2021, é o seguinte:

- Prêmio de opções de ações a receber - R\$ 72
- Prêmio de opções de ações a pagar - R\$ 124

Em 30 de junho de 2021, o resultado líquido com operações de opções de ações totaliza R\$ 88 (R\$ 967 em 2020), e seus valores brutos estão registrados em "Demais receitas-Ganhos com derivativos" e "Demais despesas - Perdas com derivativos".

(b) Valor de mercado

Derivativos

- **Swap:** A apropriação dos resultados gerados nas operações de "swap" é efetuada de forma "pro-rata", ajustados ao seu valor de mercado. As taxas utilizadas para a determinação do valor de mercado são obtidas pela estrutura temporal de taxas de juros, tomando como base os preços dos contratos de swap divulgados pela B3 S.A. – Brasil, Bolsa, Balcão. No caso de contratos de swap vinculados a títulos cambiais (USD x CDI), a determinação do valor de mercado é efetuada, obtendo-se as cotações divulgadas pela ANBIMA.
- **Mercado futuro**
Os contratos de operações realizadas no mercado futuro de ativos financeiros e mercadorias são ajustados diariamente pela variação das cotações divulgadas pela B3 S.A. – Brasil, Bolsa, Balcão. Os ajustes a mercado desses contratos são apurados diariamente por tipo e respectivo vencimento e reconhecidos em lucros ou prejuízos com ativos financeiros e mercadorias, componentes de "Ganhos com derivativos" e "Perdas com derivativos".
- **Opções de ações:** As opções de ações são valorizadas pelo preço informado pela B3 S.A. – Brasil, Bolsa, Balcão em seu Boletim de Informações Diárias - BDI. Para as opções com pouca liquidez, utiliza-se o modelo de Black&Scholes, baseando-se nas volatilidades implícitas obtidas de operações efetivadas no mercado bem como de observações de sistemas de informações do mercado, partindo do valor de mercado médio atual do ativo objeto.

8 Gerenciamento de riscos

Fundo de Investimento Caixa Multimercado RV 30 Longo Prazo

CNPJ: 03.737.188/0001-43

(Administrado pela Caixa Econômica Federal)

Notas explicativas às demonstrações contábeis

Exercícios findos em 30 de junho de 2021 e de 2020

Em milhares de Reais, exceto quando especificado

O Fundo está exposto a diversos tipos de risco que podem ser resumidos em: mercado (risco decorrente de oscilações nos preços dos ativos, em virtude de flutuações nas taxas de juros, índices de preços, taxas de câmbio, preços das ações ou índices do mercado acionário, mudanças nas correlações, etc); crédito (risco dos emissores não cumprirem suas obrigações de pagamento do principal e os juros de suas dívidas); liquidez (risco do Fundo não ter recursos necessários para o cumprimento de suas obrigações, dentro dos prazos legais, em decorrência de condições de mercado); uso de derivativos (como os instrumentos derivativos são influenciados pelos preços à vista dos ativos a eles relacionados, pelas expectativas futuras de preços, liquidez dos mercados, além do risco de crédito da contraparte).

Para o controle do risco de mercado, o modelo estatístico utilizado é o VaR (Value at Risk) juntamente com o "Stress Analysis". O controle do risco de crédito é realizado por meio de uma política de crédito e um processo de análise dos emissores dos ativos financeiros atendendo a política de investimento do Fundo. O gerenciamento do risco de liquidez é feito através do controle e monitoramento do fluxo de caixa, dos indicadores de liquidez, do cronograma de vencimentos de ativos e do perfil de distribuição das aplicações do Fundo.

Visando o controle do risco, as decisões de investimentos do Fundo são tomadas por meio de Comitês Mensais, que têm como função analisar o cenário macroeconômico a fim de auxiliar a definir estratégias de alocação e reavaliá-las. Diariamente, são analisados os mercados de atuação para auxiliar as estratégias de compra e venda de ativos.

A área de gerenciamento e monitoramento de risco é completamente separada da área de gestão.

As operações com instrumentos derivativos atenderam aos objetivos propostos no regulamento do Fundo.

Desde o início de janeiro de 2020, o surto de coronavírus impactou adversamente as atividades econômicas globais. O rápido desenvolvimento e fluidez dessa situação impedem qualquer previsão como seu impacto final. Este evento pode ter um impacto adverso contínuo nas condições econômicas e de mercado e desencadear um período de desaceleração econômica global, o que poderia trazer reflexos na precificação subsequente da carteira do Fundo, cuja a quota vem sendo divulgada diariamente ao mercado. A Administradora segue monitorando os desenvolvimentos relacionados ao coronavírus e coordenando sua resposta operacional com base nos planos de continuidade de negócios existentes e nas orientações de organizações globais de saúde, governos relevantes e melhores práticas gerais de resposta à pandemia.

Análise de Sensibilidade

O Valor em Risco ou VaR (Value at Risk) é uma ferramenta de gerenciamento de risco de mercado que, por meio de técnicas estatísticas, mensura a estimativa de perda máxima potencial dentro de um determinado período e dado um intervalo de confiança em condições normais de mercado. Para obtenção do VaR do Fundo foi utilizado o modelo paramétrico com grau de confiança de 95% para um intervalo de tempo de 21 dias.

Fundo de Investimento Caixa Multimercado RV 30 Longo Prazo

CNPJ: 03.737.188/0001-43

(Administrado pela Caixa Econômica Federal)

Notas explicativas às demonstrações contábeis

Exercícios findos em 30 de junho de 2021 e de 2020

Em milhares de Reais, exceto quando especificado

O objetivo do método utilizado pelo administrador, portanto, é quantificar a perda máxima esperada para a carteira do Fundo conforme os parâmetros definidos no parágrafo acima. Cabe ressaltar, no entanto, as limitações deste método, uma vez que ele não fornece a medida da pior perda absoluta, mas uma estimativa de perda para um dado nível de confiança.

Data Base	Patrimônio Líquido do Fundo	Valor em Risco (Var)
30/06/2021	1.998.829	1,1614%

9 Emissões e resgates de cotas

As movimentações de aplicação e resgate são efetuadas em conta do aplicador, em moeda corrente nacional, observadas as seguintes condições:

Carência	Apuração da Cota	Periodicidade de Cálculo do Valor da Cota	Liquidação Financeira da Aplicação	Conversão de Cotas da Aplicação	Conversão de Cotas do Resgate	Liquidação Financeira do Resgate
Não há	No fechamento dos mercados em que o Fundo atue	Diária	D+0 da solicitação	D+0 da solicitação	D+1 da solicitação	D+3 da solicitação

A efetiva disponibilização do crédito ocorre em horário que não sejam permitidas as movimentações bancárias devido à necessidade de se aguardar o fechamento dos mercados em que o Fundo atua para o cálculo do valor da cota.

Os feriados de âmbito estadual ou municipal na praça sede da Administradora em nada afetarão as movimentações de aplicação e resgate solicitadas nas demais praças em que houver expediente bancário normal.

10 Remuneração da administradora

A Administradora recebe taxa de administração do Fundo que é calculada sobre o patrimônio líquido do Fundo à razão de 1,00% (um inteiro por cento) ao ano, calculada e provisionada a cada dia útil, com base no patrimônio líquido do Fundo do dia útil anterior e pago mensalmente.

A taxa de administração consiste no somatório das remunerações devidas pelo Fundo à Administradora e a cada um dos prestadores dos seguintes serviços contratados pelo Fundo, se houver: gestão da carteira, consultoria de investimento, tesouraria, controladoria, distribuição de cotas, escrituração de emissão e resgate de cotas e agência classificadora de risco.

A taxa máxima de custódia a ser paga pelo Fundo ao Custodiante é de 0,018% (dezoito milésimos por cento) ao ano sobre o valor do patrimônio líquido do Fundo ou um mínimo de R\$ 1.150,00 (um mil

Fundo de Investimento Caixa Multimercado RV 30 Longo Prazo

CNPJ: 03.737.188/0001-43

(Administrado pela Caixa Econômica Federal)

Notas explicativas às demonstrações contábeis

Exercícios findos em 30 de junho de 2021 e de 2020

Em milhares de Reais, exceto quando especificado

cento e cinquenta reais), ajustado anualmente pela variação do Índice Geral de Preços do Mercado (IGPM) ou outro índice que venha substituí-lo.

No exercício findo em 30 de junho de 2021, a despesa de taxa de administração foi de R\$ 22.091 (R\$ 18.058 em 2020), registradas nas contas “Remuneração da administração” e “Serviços contratados pelo fundo”.

A taxa de administração compreende todas as taxas de administração dos fundos nos quais porventura invista.

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

11 Custódia dos títulos da carteira

Os títulos públicos, incluindo aqueles utilizados como lastro para as operações compromissadas, estão registrados no Sistema Especial de Liquidação e Custódia (SELIC) do Banco Central do Brasil, as ações, operações de “mercado futuro”, “swap” e “opções” encontram-se registrados na B3 S.A. – Brasil, Bolsa, Balcão.

12 Transações com partes relacionadas

No exercício findo em 30 de junho de 2021, o Fundo realizou as seguintes operações com partes relacionadas:

a) Despesas com parte relacionada

Despesa	Saldo	Instituição	Relacionamento
Taxa de Gestão	22.090	Caixa Econômica Federal	Administradora

b) Ativo com partes relacionadas

Operação	Saldo	Instituição	Relacionamento
Ações	13.815	Caixa Seguridade Participações S.A.	Administradora

Os títulos emitidos por empresas ligadas ao Administrador ou à Gestora se encontram em destaque no Demonstrativo da Composição e Diversificação da Carteira.

13 Legislação tributária

As operações da carteira do Fundo não estão sujeitas ao Imposto de Renda e sujeitam-se a alíquota zero de IOF-Títulos e Valores Mobiliários.

Os cotistas estão sujeito a seguinte tributação:

Fundo de Investimento Caixa Multimercado RV 30 Longo Prazo

CNPJ: 03.737.188/0001-43

(Administrado pela Caixa Econômica Federal)

Notas explicativas às demonstrações contábeis

Exercícios findos em 30 de junho de 2021 e de 2020

Em milhares de Reais, exceto quando especificado

A) O prazo da carteira do Fundo é superior a 365 dias, incidindo imposto de renda na fonte sobre os rendimentos do Fundo, por ocasião do resgate, em função do prazo de permanência, às seguintes alíquotas de longo prazo:

I-22,5% em aplicações com prazo de até 180 dias de permanência;

II-20% em aplicações com prazo de 181 dias até 360 dias de permanência;

III-17,5% em aplicações com prazo de 361 dias até 720 dias de permanência; e

IV-15% em aplicações com prazo acima de 720 dias de permanência.

B) Semestralmente, no último dia útil dos meses de maio e novembro, incidirá imposto de renda na fonte sobre os rendimentos, de acordo com o prazo da carteira do Fundo.

C) Por ocasião do resgate das cotas será aplicada alíquota complementar de acordo com o previsto nos incisos I a III do item A.

D) Incidirá IOF à alíquota de 1% ao dia, limitado aos rendimentos do Fundo, de acordo com tabela decrescente em função do prazo, disponível no site da Administradora.

E) O disposto acima não se aplica aos cotistas que não estão sujeitos à tributação, conforme legislação tributária e fiscal vigente, desde que apresentada documentação comprobatória, se for o caso.

14 Política de distribuição dos resultados

Eventuais resultados relativos a ativos componentes da carteira do Fundo são incorporados ao seu respectivo patrimônio, quando do seu pagamento ou distribuição pelos emissores de tais ativos.

15 Política de divulgação das informações

A divulgação das informações do Fundo aos cotistas é realizada de acordo com a legislação em vigor através de correspondência, inclusive por meio eletrônico e canais eletrônicos, incluindo a rede mundial de computadores.

16 Outras informações

As rentabilidades nos últimos exercícios são as seguintes:

Data	Rentabilidade (%)	Patrimônio líquido médio
Exercício findo em 30 de junho de 2021	8,23	2.216.292
Exercício findo em 30 de junho de 2020	3,61	1.805.061

O Fundo não possui *benchmark* a ele relacionado.

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

17 Demandas judiciais

Fundo de Investimento Caixa Multimercado RV 30 Longo Prazo

CNPJ: 03.737.188/0001-43

(Administrado pela Caixa Econômica Federal)

Notas explicativas às demonstrações contábeis

Exercícios findos em 30 de junho de 2021 e de 2020

Em milhares de Reais, exceto quando especificado

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

18 Contrato de prestação de serviços de controladoria e custódia

A Administradora contratou o Banco Bradesco S.A., para prestar serviços de controladoria e custódia, relativos a este Fundo, de acordo com as normas Legais e Regulamentares.

19 Prestação de outros serviços e política de independência do auditor

Em atendimento à Instrução nº 381/03 da Comissão de Valores Mobiliários, informamos que a Administradora, no exercício, não contratou nem teve serviços prestados pela KPMG Auditores Independentes, relacionados a este Fundo de Investimento por ela administrado que não os serviços de auditoria externa, em patamares superiores a 5% do total dos custos de auditoria externa. A política adotada atende aos princípios que preservam a independência do auditor, de acordo com os critérios internacionalmente aceitos, qual seja o auditor não deve auditar o seu próprio trabalho, nem exercer funções gerenciais no seu cliente ou promover os interesses deste.

20 Informações adicionais

A diretora e o contabilista responsáveis pelo Fundo na data base são os seguintes:

Contador:

Ricardo Ignácio Rocha

CRC 1 SP 213357/O-6-T-PR

Diretora responsável:

Laiza Fabíola Martins de Santa Rosa

Fundo de Investimento Caixa Multimercado RV 30 Longo Prazo
(Administrado pela Caixa Econômica Federal)

Exercícios findos em 30 de junho de 2021 e de 2020

Demonstrativo das evoluções do valor da cota e patrimônio líquido médio

A evolução do valor da cota no último dia de cada um dos últimos doze meses e as respectivas variações mensais e acumuladas para cada mês, foram os seguintes:

Data	Valor	Patrimônio		
	da cota (R\$)	Líquido médio (R\$ mil)	Mensal (%)	Acumulada (%)
30/06/2020	7,514548			
31/07/2020	7,697649	2.432.022	2,44	2,44
31/08/2020	7,637968	2.430.530	(0,78)	1,64
30/09/2020	7,481070	2.360.033	(2,05)	(0,45)
31/10/2020	7,452945	2.282.875	(0,38)	(0,82)
30/11/2020	7,752303	2.264.483	4,02	3,16
31/12/2020	7,950814	2.245.910	2,56	5,81
31/01/2021	7,904758	2.227.401	(0,58)	5,19
28/02/2021	7,815062	2.186.539	(1,13)	4,00
31/03/2021	7,938544	2.108.965	1,58	5,64
30/04/2021	7,949152	2.057.470	0,13	5,78
31/05/2021	8,101016	1.978.639	1,91	7,80
30/06/2021	8,132985	1.999.917	0,39	8,23

O Fundo não possui *benchmark* a ele relacionado.

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