



FUNPREVI

Relatório Mensal de Investimentos

Valores Mobiliários

Fevereiro 2026

PREVI-RIO

AUTARQUIA GESTORA DO FUNPREVI

PRESIDENTE

BERNARDO EGAS LIMA FONSECA

DIRETOR DE INVESTIMENTOS

GABRIEL RICCIOPPO DA SILVA

GERENTE DE ATIVOS MOBILIÁRIOS

MARIA FERNANDA MARQUES LIMA MURÇA

EQUIPE DA GERÊNCIA DE ATIVOS MOBILIÁRIOS (DIN/GAM)

LÚCIA DE FÁTIMA MANSUR TRINDADE DE ALMEIDA

MÁRCIA FERREIRA FERRAZ

MÁRCIA SATIKO TOMARI

RICARDO JOSÉ PEREIRA ALVAREZ

COMITÊ DE INVESTIMENTOS

ALEXANDRA DOS PASSOS LYRIO FIALHO

GABRIEL RICCIOPPO DA SILVA

JORGE EDMUNDO FERREIRA FARAH

VIRGINIO VIEIRA OLIVEIRA

MARIA FERNANDA MARQUES LIMA MURÇA





BERNARDO EGAS LIMA FONSECA

VANESSA GONÇALVES QUINTINO EVANGELISTA



1. FUNDOS DE INVESTIMENTO

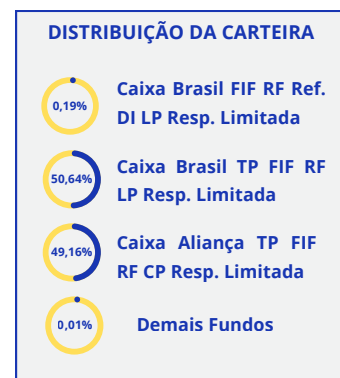
FUNDOS DE INVESTIMENTO ³	VOLATILIDADE ¹	LIQUIDEZ	TAXA DE ADMINISTRAÇÃO
Caixa Brasil FIF RF Ref. DI LP Responsabilidade Limitada	0,04%	DIÁRIA	0,20%
Caixa Brasil Disp. FIC de FIF RF Simples Responsabilidade Limitada	0,03%	DIÁRIA	0,80%
Caixa Brasil TP FIF RF LP Responsabilidade Limitada	0,09%	DIÁRIA	0,20%
Caixa Aliança TP FIF RF CP Responsabilidade Limitada	0,03%	DIÁRIA	0,20%
Caixa Brasil IRFM-1 TP FIF RF Responsabilidade Limitada	0,26%	DIÁRIA	0,20%

GRAU DE RISCO	
	CONSERVADOR
	MODERADO
	ARROJADO
	AGRESSIVO

2. CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - POSIÇÃO: 27/02/2026

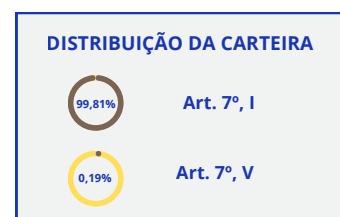
2.1 APLICAÇÕES POR FUNDO DE INVESTIMENTO

FUNDOS DE INVESTIMENTO	VALORES APLICADOS	ENQUADRAMENTO (RES. CMN 5.272/2025)
Caixa Brasil FIF RF Ref. DI LP Responsabilidade Limitada	R\$ 853.354,94	Art. 7º, V
Caixa Brasil Disp. FIC de FIF RF Simples Responsabilidade Limitada	R\$ 5,60	Art. 7º, I
Caixa Brasil TP FIF RF LP Responsabilidade Limitada	R\$ 230.249.501,57	Art. 7º, I
Caixa Aliança TP FIF RF CP Responsabilidade Limitada	R\$ 223.548.904,17	Art. 7º, I
Caixa Brasil IRFM-1 TP FIF RF Responsabilidade Limitada	R\$ 41.605,85	Art. 7º, I



2.1 APLICAÇÕES POR ENQUADRAMENTO LEGAL

SEGMENTO (RES. CMN 4.963/21)	LIMITES PARA APLICAÇÃO		VALORES APLICADOS
	RES. CMN 5.272/25	P.A.I.?(ESTRATÉGIA)	
Art. 7º, I	100%	80%	R\$ 453.840.017,19
Art. 7º, V	80%	20%	R\$ 853.354,94



Nota:

1. Volatilidade dos últimos 12 meses

2. Plano Anual de Investimentos

3. Os nomes dos Fundos de Investimentos foram adaptados para as novas nomenclaturas utilizadas em regulamento. Não houve alteração nas características de alocação dos mesmos.

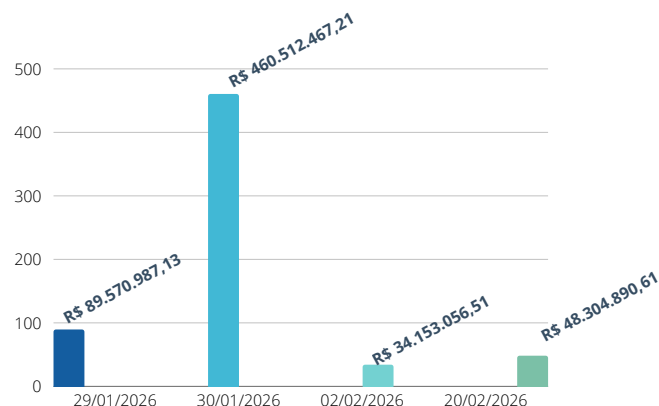
3. VALORES MOBILIÁRIOS - DE 29/01/2026 A 20/02/2026

29/01/2026 - Posição anterior a arrecadação das contribuições patronal e suplementar do mês janeiro/2026.

30/01/2026 - Após a arrecadação das contribuições patronal e suplementar do mês janeiro/2026.

02/02/2026 - Após o resgate dos recursos necessários ao pagamento das folhas líquidas⁴ de aposentadoria e de pensão, referentes a janeiro/2026.

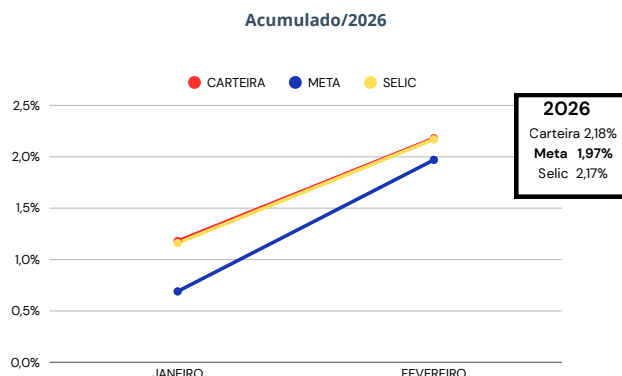
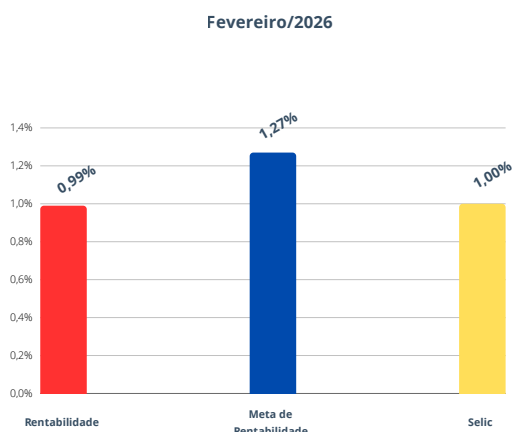
20/02/2026 - Após o Resgate dos recursos necessários ao pagamento dos valores das consignações, considerando as receitas arrecadadas até esta data.



4. DESEMPENHO DOS FUNDOS

FUNDOS DE INVESTIMENTO	FEVEREIRO/26			ACUMULADO/2026		
	RENTABILIDADE NOMINAL	%META	%SELIC	RENTABILIDADE NOMINAL	%META	%SELIC
Caixa Brasil FIF RF Ref. DI LP Responsabilidade Limitada	1,0048%	79,39%	100,78%	2,1868%	111,11%	100,64%
Caixa Brasil Disp. FIC de FIF RF Simples Responsabilidade Limitada	0,9342%	73,81%	93,70%	2,0304%	103,17%	93,45%
Caixa Brasil TP FIF RF LP Responsabilidade Limitada	0,9861%	77,91%	98,90%	2,2124%	112,41%	101,82%
Caixa Aliança TP FIF RF CP Responsabilidade Limitada	0,9806%	77,48%	98,36%	2,1368%	108,57%	98,34%
Caixa Brasil IRFM-1 TP FIF RF Responsabilidade Limitada	1,0101%	79,81%	101,31%	2,2096%	112,28%	101,70%

5. DESEMPENHO DA CARTEIRA



Nota:

4. Folha Líquida: é o resultado da subtração dos valores das consignações da folha bruta das aposentadorias e das pensões.

6. RATING DA ADMINISTRADORA DOS FUNDOS DE INVESTIMENTO

Os fundos de investimentos que compõem a carteira do FUNPREVI são administrados pela Caixa Econômica Federal e geridos pela Caixa Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A. (Caixa DTVM), subsidiária da mencionada instituição financeira, e auditados pela Deloitte Touche Tohmatsu Auditores Independentes LTDA.

A Caixa Econômica é uma das mais antigas e sólidas instituições financeiras do Brasil, sendo uma das principais no que tange à gestão de ativos e poupança no Brasil.

As notas atribuídas à Caixa Econômica Federal pelas agências classificadoras de risco abaixo listadas avalizam a sua capacidade e disposição em honrar com suas obrigações tempestivamente.

É importante destacar que a Caixa Econômica Federal é instituição financeira associada à Associação Brasileira das Entidades dos Mercados Financeiro e de Capitais - ANBIMA, e segue as regras de conduta por ela estabelecida, as quais tem por objetivo garantir a sustentabilidade do mercado e a segurança do investidor.

Ratings Perspectiva	Escala Global				Escala Nacional	
	Moeda Local		Moeda Estrangeira		Longo Prazo	Curto Prazo
	Longo Prazo	Curto Prazo	Longo Prazo	Curto Prazo		
Fitch Ratings	BB (Estável)	B	BB (Estável)	B	AAA (bra) (Estável)	F1+ (bra)
Moody's	Ba1 (Estável)	Not Prime	Ba1 (Estável)	Not Prime	AAA.br (Estável)	M1, A-1.br
Standard Poor's	BB (Estável)	B	BB (Estável)	B	BrAAA (Estável)	brA-1+

Fitch: último relatório (Mar/26)
 Moody's Escala Global: último relatório (Jun/25)
 Moody's Escala Nacional: último relatório (Jan/26)
 S&P Escala Global: último relatório (Mar/25); S&P Escala Nacional: último relatório (Out/25)

7. COMENTÁRIOS

Os fundos de investimentos que compõem a carteira do FUNPREVI apresentaram, em fevereiro, rentabilidades em relação à meta de rentabilidade⁵ de 73,81% (Caixa Brasil Disp. FIC de FIF RF Simples Responsabilidade Limitada), 79,39% (Caixa Brasil FIF RF Ref. DI LP Responsabilidade Limitada), 77,91% Caixa Brasil TP FIF RF LP Responsabilidade Limitada, 77,48% (Caixa Aliança TP FIF RF CP Responsabilidade Limitada) e 79,81% (Caixa Brasil IRFM-1 TP FIF RF Responsabilidade Limitada), todos da Caixa Econômica Federal. Desta forma, a carteira registrou um desempenho no mês de 78,04% em relação à meta e de 99,07% em relação à taxa Selic. No ano, o desempenho acumulado da carteira foi de 110,61% e de 100,18% em relação à meta e à taxa Selic, respectivamente.

8. PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

Os fundos que atualmente compõem a carteira do FUNPREVI estão aderentes à Resolução CMN nº 5.272/25 e à Política Anual de Investimentos para o exercício de 2026, aprovada pelo Conselho de Administração do PREVI-RIO na 214ª Reunião Ordinária, realizada em 24/02/2026, apresentando baixo risco. Ressalta-se que, em fevereiro de 2026, desempenho da carteira foi inferior à meta de rentabilidade no mês, permanecendo superior à mesma no acumulado do ano.

NOTAS:

5 - Meta de rentabilidade de 6% + IPCA-E



PREVI-RIO

