

ELOS

Alterações nos Perfis de Investimento

Florianópolis – Junho 2023



Contexto

- Em **fevereiro de 2014** o Conselho Deliberativo da Elos aprovou a DCD 316-01 resultando na criação dos atuais perfis de investimento do Plano CD Eletrosul.
- As premissas atualmente vigentes determinaram **2 perfis aos participantes assistidos** e **3 perfis aos demais participantes**.
- Em **pesquisa realizada em 2021** pela Elos junto aos participantes, foi constatada a insatisfação com relação aos seguintes aspectos:
 - i. Insuficiência de perfis para os participantes assistidos que desejem alocação de maior risco;
 - ii. Dificuldade dos participantes em tomarem sua própria decisão pelo perfil mais adequado à sua tolerância de risco/retorno.

Contexto

- Com vistas a atualizar os perfis existentes na Fundação, foram realizadas **diversas tratativas com a Consultoria Financeira Aditus**.
- Para viabilizar a nova estrutura, ao longo de 2022 a Gerência de Investimentos **reestruturou a carteira de investimentos**, criando Fundos Exclusivos de Investimento no Exterior, Renda Variável, Multimercado Estruturado, Renda Fixa Crédito e Renda Fixa Ativa e **aprova novo Fundo** para a gestão de caixa.
- Em **dezembro de 2022** foram aprovados os novos perfis para o Plano Futurize.

Contexto - Definição dos Perfis

38%

de votos

Apontaram para a decisão dos nomes para os perfis do Futurize. Sendo eles: Protetor, Equilibrado, Dinâmico e Enérgico¹

48

Cenários avaliados

A Fronteira Eficiente elaborada pela Aditus é um estudo que considera o conjunto de carteiras ótimas que oferecem o maior retorno esperado para cada nível de risco

¹ após alinhamento com CRT nome foi trocado para visionário

Vocês sabem quem são nossos principais parceiros?

Nossos Parceiros

Schroders



BNP PARIBAS



SulAmérica



Estratégia:

Exterior

Multimercado

Renda Fixa Ativa

Tempo de Experiência

215 anos

162 anos

125 anos

Colaboradores

5.700

190.000

4.000

Capital sob Gestão

US\$ 940 bi

EUR 500 bi

R\$ 55 bi

Locais de Atuação

Europa, Américas, Ásia
e Oriente Médio

65 países

Nacional

ELOS

NC - Público

Vocês sabem quem são nossos principais parceiros?

Nossos Parceiros



Estratégia:

Renda Fixa Crédito

Renda Variável e
Renda Fixa Caixa

Tempo de Experiência

79 anos

79 anos

Colaboradores

90.000

99.000

Capital sob Gestão

R\$ 560 bi

R\$ 760 bi

Locais de Atuação

Brasil, Europa, USA,
Hong Kong

Brasil, Europa, USA,
América do Sul

ELOS

NC - Público

Perfil Protetor



Perfil Protetor

Alocação e estratégia objetivas



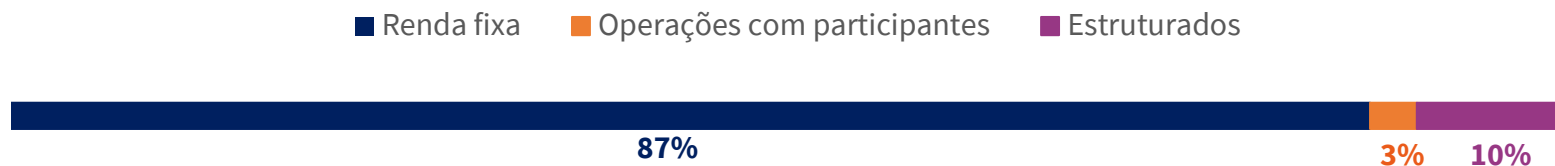
Fundo	Estratégia	Alocação
Itaú Institucional	Renda fixa CDI	75%
FIM FICUS	Renda fixa ativa	15%
Barra velha High Yield	Crédito privado	10%

Perfil Equilibrado



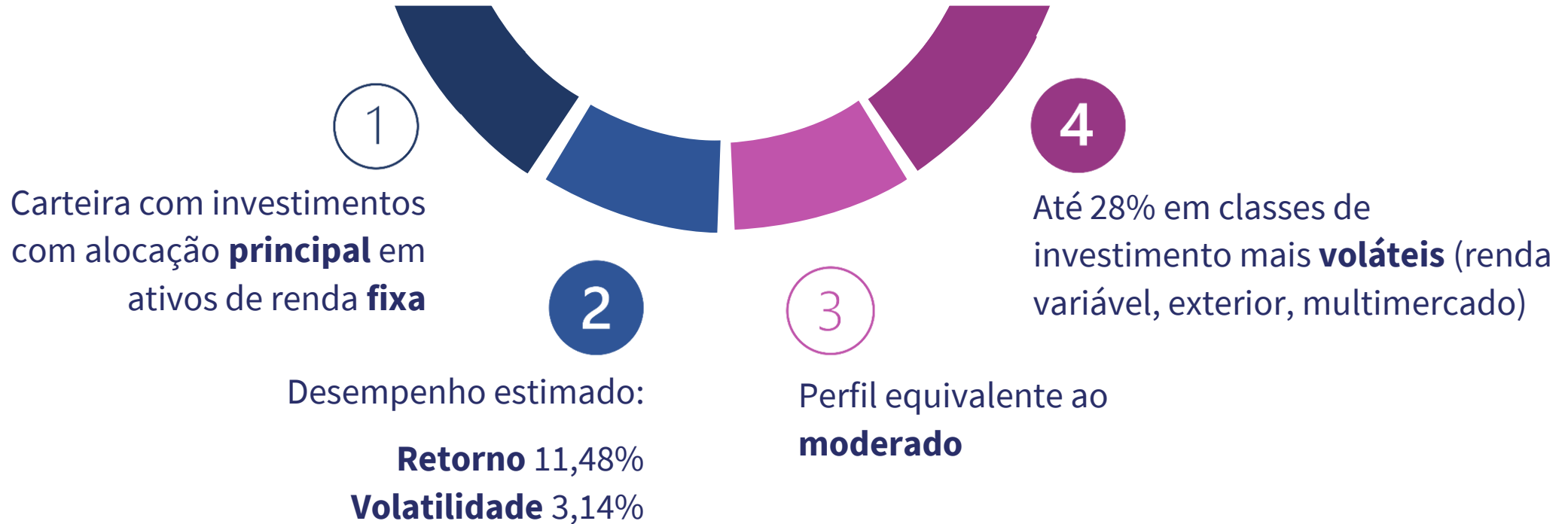
Perfil Equilibrado

Alocação estimada e estratégias objetivas



Fundo	Estratégia	Alocação
Itaú Institucional	Renda fixa CDI	40%
FIM FICUS	Renda fixa ativa	25%
Barra velha High Yield	Crédito privado	25%
BNP PARIBAS	Multimercado estruturado	10%

Perfil Dinâmico



Perfil Dinâmico

Alocação estimada e estratégias objetivas



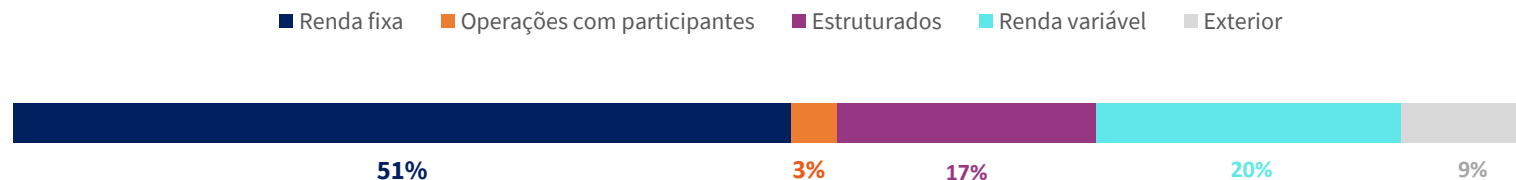
Fundo	Estratégia	Alocação
Itaú Institucional	Renda fixa CDI	22%
FIM FICUS	Renda fixa ativa	25%
Barra velha High Yield	Crédito privado	25%
BNP PARIBAS	Multimercado estruturado	13%
ELOS FIC FIA	Renda variável	10%
Schroder	Investimento no exterior	5%

Perfil Visionário



Perfil Visionário

Alocação estimada e estratégias objetivas



Fundo	Estratégia	Alocação
Itaú Institucional	Renda fixa CDI	14%
FIM FICUS	Renda fixa ativa	20%
Barra velha High Yield	Crédito privado	20%
ELOS FIC FIA	Renda variável	20%
BNP PARIBAS	Multimercado estruturado	17%
Schroder	Investimento no exterior	9%

Resumo dos Perfis



¹ Retorno: Estimativa em base nominais que consideraram diferentes premissas que podem se alterar ao longo do tempo.

² Volatilidade: Medida de risco estimada que pode se alterar ao longo do tempo.

Caso o participante não responda ao teste de *suitability* até 30/06 será aplicada regra De x Para

Perfil CD - Estrutural Atual	Perfil CD - Estrutura Proposta
A1	Perfil Protetor / Superconservador
A2	Perfil Protetor / Superconservador
B1	Perfil Protetor / Superconservador
B2	Perfil Equilibrado / Conservador
B3	Perfil Dinâmico / Moderado

ELOS

Ed. Emedaux – Sobreloja
Praça Pereira Oliveira, 64
Centro – Florianópolis/SC

www.elos.org.br

 fundacaoelos

 elosprevidencia

 fundacaoelos