

Reporte Carteras Modelo

Agosto 2024



Internacional: Comportamiento mercado internacional

ACTIVOS INTERNACIONALES

	2024	jul-24	Last Semester	2023
Activos Internacionales	YTD	MTD		
→ Renta Fija Global				
RF EE.UU.	2.13%	2.93%	-0.42%	5.53%
RF Mundial Soberana	-0.76%	3.42%	-2.94%	4.35%
RF Mundial Corporativa	2.28%	2.83%	-0.19%	9.61%
RF Emergente	4.54%	2.41%	2.93%	9.09%
→ Renta Variable Global				
Acciones EE.UU.	17.24%	0.90%	14.96%	26.31%
Acciones Emergentes	8.82%	0.61%	9.40%	8.95%
Acciones Japon	12.48%	4.69%	3.48%	20.29%
Acciones Asia Pacifico	3.80%	2.33%	3.77%	5.76%
Acciones Europa	9.35%	1.60%	7.21%	20.14%
→ Commodities				
Indice Commodity Compuesto	-1.68%	-4.81%	3.10%	-12.55%
WTI	10.65%	-5.36%	11.83%	-2.74%
Brent	8.06%	-5.69%	10.43%	-2.79%
Gold	18.88%	4.96%	13.14%	13.10%
→ Monedas y otros				
Indice Bloomberg Dólar	2.64%	-1.36%	3.47%	-2.70%
DXY	1.86%	-1.70%	3.38%	-2.11%
Dólar Mercados Emergentes	-4.08%	0.30%	-3.86%	-3.75%

Internacional: Tabla de proyecciones, principales variables macro**

	HOY	2024	2025	2026
→ EE.UU.				
FED funds rate (Upper Bound)	5.50%	5.00%	3.90%	3.40%
IPC	3.00%	3.00%	2.40%	2.30%
PIB	2,8%/2Q24	2.30%	1.70%	2.00%
→ Euro				
ECB Reference rate	4.50%	3.40%	2.65%	2.50%
IPC	2.60%	2.40%	2.10%	2.00%
PIB	0,6%/2Q24	0.70%	1.40%	1.30%
EURUSD	1.08	1.09	1.12	1.13
→ China				
PIB	4,7%/2Q24	4.90%	4.50%	4.30%

Colombia: Comportamiento mercado local

ACTIVOS LOCALES

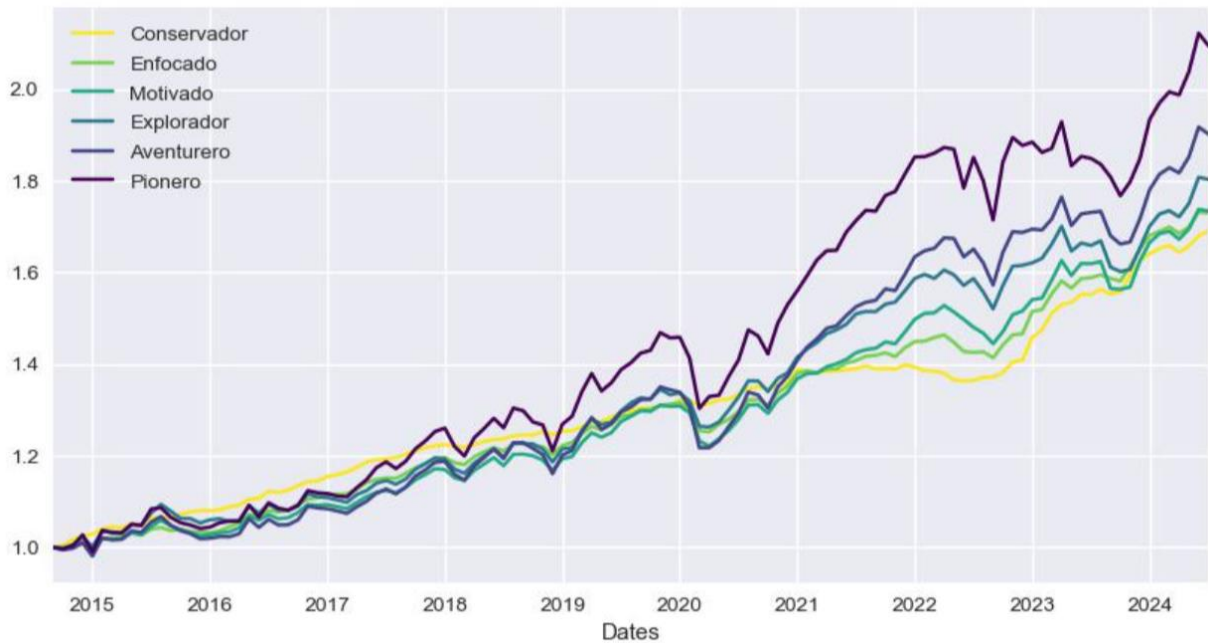
Performance	2024	jul-24		
Activos Locales	YTD	MTD	Last Semester	2023
→ Renta Fija Local				
COLTES TF	2.78%	1.45%	-1.36%	29.62%
COLTES TF CP	5.90%	1.87%	2.30%	20.01%
COLTES TF LP	1.26%	1.25%	-3.17%	35.60%
COLTES UVR	-3.13%	0.70%	-4.32%	35.33%
COLTES UVR CP	4.42%	1.36%	2.35%	19.64%
COLTES UVR LP	-5.73%	0.40%	-6.57%	42.15%
GLOBAL X TES COLOMBIA	-0.30%	1.58%		
→ Renta Variable Local				
MSCI COLCAP	10.08%	-2.55%	6.44%	-6.91%
GLOBAL X Colombia Select	13.99%	-2.80%	10.97%	5.85%
GLOBAL X MSCI Colombia ETF	7.87%	0.52%	4.08%	24.92%
→ Moneda				
Peso Colombiano	-4.80%	1.69%	-5.82%	20.13%

Colombia: Tabla de proyecciones, principales variables macro**

	HOY	2024	2025	2026
Tasa de intervención - Banrep	10.75%	8.50%	5.50%	5.50%
IPC	7.18%	5.70%	4.00%	3.50%
PIB	0.7%/1Q24	1.50%	2.60%	3.00%
USDCOP	4060	4130	4025	4000

Desempeño Carteras Modelo – Allianz

(Cierre Julio 2024)



	Perfil Conservador	Perfil Enfocado	Perfil Motivado	Perfil Explorador	Perfil Aventurero	Perfil Pionero
Rentabilidad 5 años	5,46	6,10	6,34	6,80	7,98	8,58
Rentabilidad Desde el inicio	5,48	5,73	5,76	6,18	6,76	7,81
Volatilidad 5 años	2,35	3,33	4,61	5,21	6,41	8,13
Máxima Caída Observada (5Y)	-2,53	-4,87	-6,84	-6,12	-9,83	-11,27
Comisión	2,07%	2,36%	2,62%	2,59%	2,60%	2,72%

*Los resultados obtenidos toman en cuenta el comportamiento de los Benchmark objetivo para cada vehículo de inversión y para la composición de cada perfil de riesgo.

¡ Gracias !