

Reporte Carteras Modelo

Junio 2024



Internacional: Comportamiento mercado internacional

ACTIVOS INTERNACIONALES

	2024	may-24		
Activos Internacionales	YTD	MTD	Last Semester	2023
→ Renta Fija Global				
RF EE.UU.	-1.49%	0.96%	1.66%	5.53%
RF Mundial Soberana	-3.69%	0.81%	0.63%	4.35%
RF Mundial Corporativa	-0.79%	1.32%	3.03%	9.61%
RF Emergente	1.84%	1.54%	6.72%	9.09%
→ Renta Variable Global				
Acciones EE.UU.	10.97%	4.47%	12.70%	26.31%
Acciones Emergentes	6.19%	2.85%	6.11%	8.95%
Acciones Japon	7.08%	1.42%	10.66%	20.29%
Acciones Asia Pacifico	1.63%	4.38%	4.42%	5.76%
Acciones Europa	9.24%	5.49%	10.71%	20.14%
→ Commodities				
Indice Commodity Compuesto	6.07%	3.50%	-1.66%	-12.55%
WTI	9.83%	-0.68%	6.23%	-2.95%
Brent	8.68%	-1.10%	6.37%	-2.79%
Gold	13.80%	1.01%	16.39%	13.10%
→ Monedas y otros				
Indice Bloomberg Dólar	2.51%	-0.93%	1.35%	-2.70%
DXY	2.46%	-0.98%	2.08%	-2.11%
Dólar Mercados Emergentes	-2.31%	0.84%	-3.61%	-3.75%

*Fuente: Bloomberg
 ** Al 30 de mayo de 2024

Internacional: Tabla de proyecciones, principales variables macro**

	HOY	2024	2025	2026
→ EE.UU.				
FED funds rate (Upper Bound)	5.50%	5.00%	4.00%	3.50%
IPC	3.40%	3.20%	2.40%	2.30%
PIB	1,3%/1Q24	2.40%	1.80%	2.00%
→ Euro				
ECB Reference rate	4.50%	3.15%	2.40%	2.40%
IPC	2.60%	2.40%	2.10%	2.00%
PIB	0,4%/1Q24	0.70%	1.40%	1.40%
EURUSD	1.08	1.08	1.12	1.12
→ China				
PIB	5.3%/1Q24	4.90%	4.50%	4.20%

*Fuente: Bloomberg
 **Mediana sondeo analistas
 *** Al 31 de mayo de 2024

Colombia: Comportamiento mercado local

ACTIVOS LOCALES

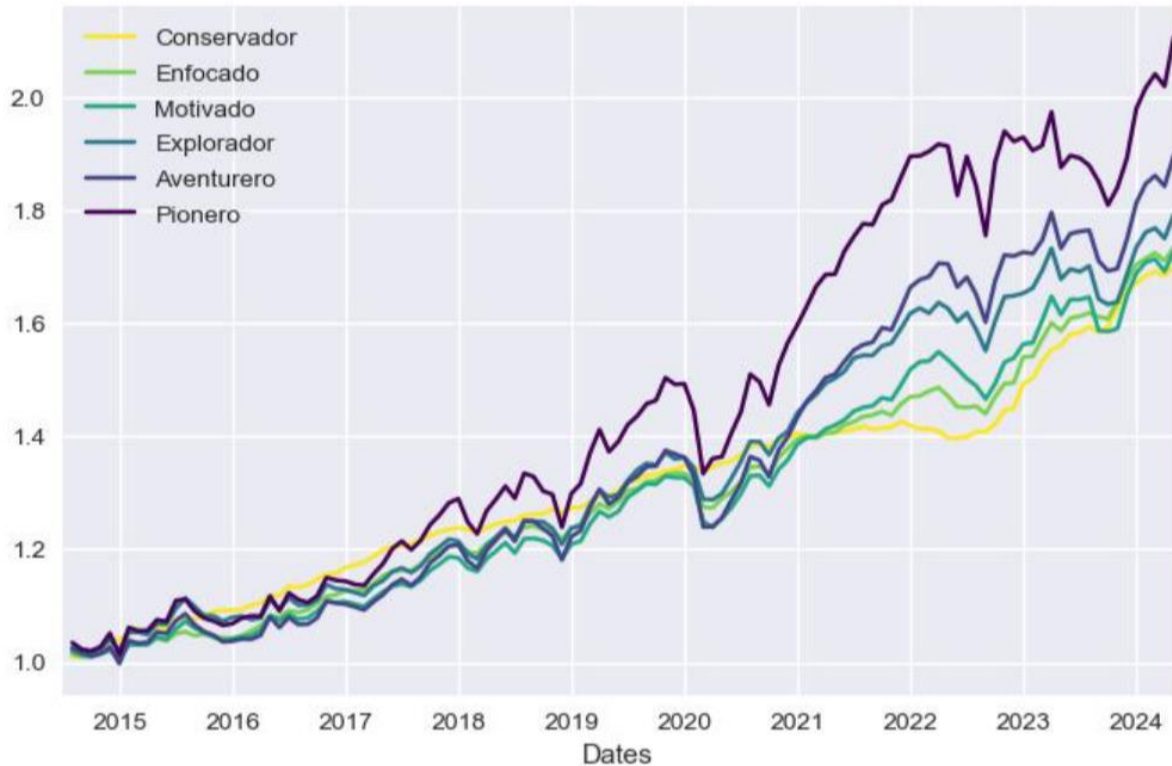
Performance	2024	may-24		
Activos Locales	YTD	MTD	Last Semester	2023
→ Renta Fija Local				
COLTES TF	-0.70%	-1.03%	5.56%	29.62%
COLTES TF CP	2.37%	0.41%	5.50%	20.01%
COLTES TF LP	-2.19%	-1.73%	5.64%	35.60%
COLTES UVR	-5.11%	-0.33%	0.52%	35.33%
COLTES UVR CP	1.83%	0.07%	5.00%	19.64%
COLTES UVR LP	-7.49%	-0.57%	-0.96%	42.15%
GLOBAL X TES COLOMBIA	-0.79%	0.87%		
→ Renta Variable Local				
MSCI COLCAP	14.83%	3.42%	22.56%	-6.91%
GLOBAL X Colombia Select	17.71%	1.30%	35.17%	5.85%
GLOBAL X MSCI Colombia ETF	15.10%	4.55%	27.84%	24.92%
→ Moneda				
Peso Colombiano	0.36%	1.49%	1.18%	20.13%

Colombia: Tabla de proyecciones, principales variables macro**

	HOY	2024	2025	2026
Tasa de intervención - Banrep	11.75%	8.50%	5.50%	5.50%
IPC	7.16%	5.60%	4.00%	3.50%
PIB	0.7%/1Q24	1.30%	2.50%	3.00%
USDCOP	3868	4050	3950	3800

Desempeño Carteras Modelo – Allianz

(Cierre Mayo 2024)



	Perfil Conservador	Perfil Enfocado	Perfil Motivado	Perfil Explorador	Perfil Aventurero	Perfil Pionero
Rentabilidad 5 años	5,59	6,40	6,55	6,76	8,19	8,94
Rentabilidad Desde el inicio	5,55	5,76	5,71	6,11	6,73	7,87
Volatilidad 5 años	2,03	3,22	4,60	5,18	6,41	8,17
Máxima Caída Observada (5Y)	-2,07	-4,65	-6,83	-6,11	-9,83	-11,27

*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 !