

Reporte Carteras Modelo

Mayo 2024



Internacional: Comportamiento mercado internacional

ACTIVOS INTERNACIONALES

	2024	abr-24		
Activos Internacionales	YTD	Last Month	Last Semester	2023
→ Renta Fija Global				
RF EE.UU.	-1.56%	-1.69%	1.66%	5.53%
RF Mundial Soberana	-3.25%	-1.84%	0.63%	4.35%
RF Mundial Corporativa	-1.05%	-1.46%	3.03%	9.61%
RF Emergente	1.14%	-0.99%	6.72%	9.09%
→ Renta Variable Global				
Acciones EE.UU.	8.55%	-3.26%	12.70%	26.31%
Acciones Emergentes	6.87%	-0.70%	6.11%	8.95%
Acciones Japon	8.97%	-3.79%	10.66%	20.29%
Acciones Asia Pacifico	0.77%	-2.66%	4.42%	5.76%
Acciones Europa	5.66%	-1.38%	10.71%	20.14%
→ Commodities				
Indice Commodity Compuesto	3.31%	0.97%	-1.66%	-12.55%
WTI	9.95%	-2.72%	6.58%	-3.31%
Brent	9.79%	-1.77%	6.84%	-2.88%
Gold	11.79%	0.24%	16.39%	13.10%
→ Monedas y otros				
Indice Bloomberg Dólar	2.42%	1.50%	1.35%	-2.70%
DXY	2.77%	1.34%	2.08%	-2.11%
Dólar Mercados Emergentes	-2.21%	-0.82%	-3.61%	-3.75%

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	3.50%	3.10%	2.40%	2.30%
PIB	1,6%/1Q24	2.40%	1.80%	2.00%
→ Euro				
ECB Reference rate	4.50%	3.15%	2.40%	2.40%
IPC	2.40%	2.30%	2.10%	2.00%
PIB	0,4%/1Q24	0.50%	1.40%	1.40%
EURUSD	1.07	1.09	1.12	1.13
→ China				
PIB	5.3%/1Q24	4.80%	4.40%	4.20%

*Fuente: Bloomberg

**Mediana sondeo analistas

*** Al 06 de mayo de 2024

Colombia: Comportamiento mercado local

ACTIVOS LOCALES

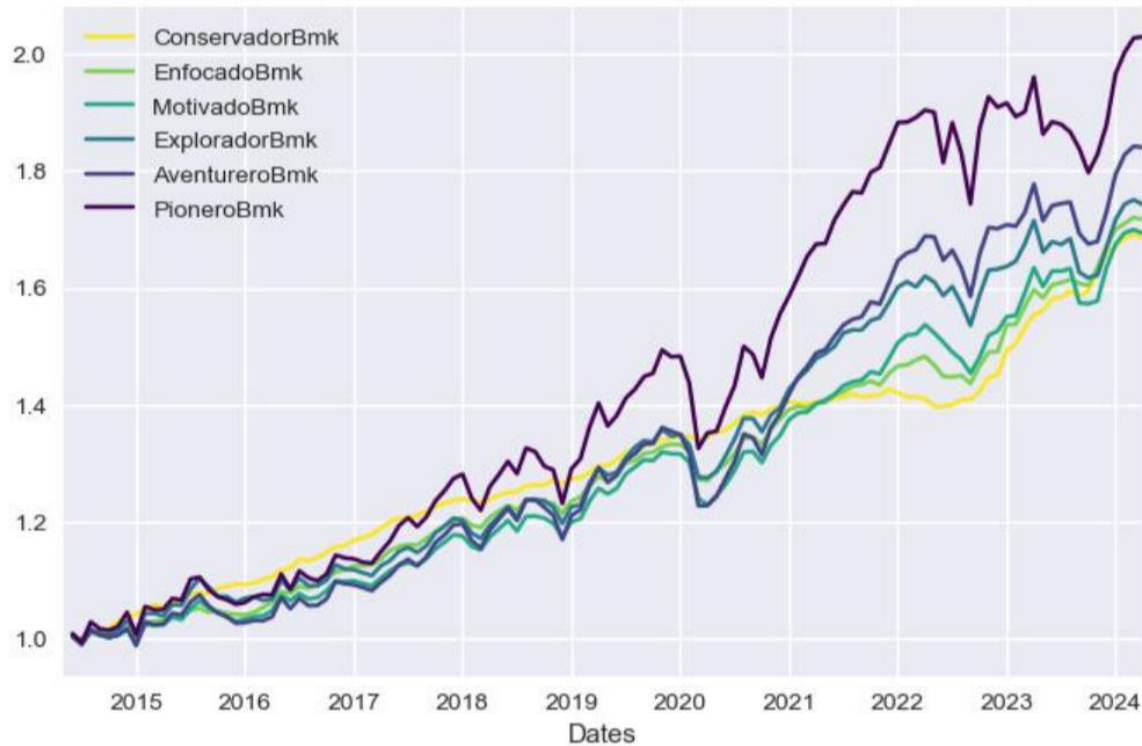
Performance	2024	abr-24		
Activos Locales	YTD	Last Month	Last Semester	2023
→ Renta Fija Local				
COLTES TF	0.72%	-0.20%	5.56%	29.62%
COLTES TF CP	2.18%	-0.36%	5.50%	20.01%
COLTES TF LP	-0.02%	-0.12%	5.64%	35.60%
COLTES UVR	-4.53%	-1.44%	0.52%	35.33%
COLTES UVR CP	1.83%	0.31%	5.00%	19.64%
COLTES UVR LP	-6.59%	-2.03%	-0.96%	42.15%
GLOBAL X TES COLOMBIA	-1.49%	#N/D		
→ Renta Variable Local				
MSCI COLCAP	13.34%	-1.12%	22.56%	-6.91%
GLOBAL X Colombia Select	16.69%	4.81%	35.17%	5.85%
GLOBAL X MSCI Colombia ETF	10.91%	-0.97%	27.84%	24.92%
→ Moneda				
Peso Colombiano	-0.85%	-2.52%	1.18%	20.13%

Colombia: Tabla de proyecciones, principales variables macro**

	HOY	2024	2025	2026
Tasa de intervención - Banrep	11.75%	8.25%	5.50%	5.50%
IPC	7.36%	5.50%	4.00%	3.50%
PIB	0.6/2023	1.30%	2.50%	3.00%
USDCOP	3913	4050	4100	3800

Desempeño Carteras Modelo – Allianz

(Cierre Abril 2024)



	Perfil Conservador	Perfil Enfocado	Perfil Motivado	Perfil Explorador	Perfil Aventurero	Perfil Pionero
Rentabilidad 5 años	5,41	6,10	6,14	6,18	7,32	7,67
Rentabilidad Desde el inicio	5,40	5,60	5,46	5,76	6,35	7,40
Volatilidad 5 años	2,03	3,19	4,56	5,14	6,36	8,06
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 !