

Reporte Carteras Modelo

Octubre 2024



*Fuente: Bloomberg
 **Mediana sondeo analistas
 *** Al 30 de septiembre de 2024

Internacional: Comportamiento mercado internacional

	2024	sep-24		
Activos Internacionales	YTD	Last Month	Last Semester	2023
→ Renta Fija Global				
RF EE.UU.	5.08%	1.34%	7.80%	5.53%
RF Mundial Soberana	2.93%	2.08%	7.97%	4.35%
RF Mundial Corporativa	5.92%	1.90%	8.63%	9.61%
RF Emergente	8.74%	1.76%	8.48%	9.09%
→ Renta Variable Global				
Acciones EE.UU.	21.58%	2.17%	14.57%	26.31%
Acciones Emergentes	19.34%	5.74%	14.67%	8.95%
Acciones Japon	12.90%	-0.60%	4.80%	20.29%
Acciones Asia Pacifico	16.45%	7.11%	20.26%	5.76%
Acciones Europa	12.37%	0.14%	10.83%	20.14%
→ Commodities				
Indice Commodity Compuesto	3.51%	4.43%	-2.40%	-12.55%
WTI	0.42%	-6.17%	-15.88%	-2.74%
Brent	-0.51%	-6.56%	-16.01%	-2.61%
Gold	29.13%	5.40%	10.54%	13.10%
→ Monedas y otros				
Indice Bloomberg Dólar	0.61%	-1.01%	-3.08%	-2.70%
DXV	-0.51%	-0.86%	-5.11%	-2.11%
Dólar Mercados Emergentes	-3.82%	0.98%	0.44%	-3.75%

Internacional: Tabla de proyecciones, principales variables macro**

	HOY	2024	2025	2026
→ EE.UU.				
FED funds rate (Upper Bound)	5.00%	4.45%	3.35%	3.05%
IPC	2.50%	2.90%	2.20%	2.30%
PIB	3.0%/2Q24	2.60%	1.80%	2.00%
→ Euro				
ECB Reference rate	3.90%	3.40%	2.40%	2.40%
IPC	1.80%	2.40%	2.10%	2.00%
PIB	0,6%/2Q24	0.70%	1.30%	1.40%
EURUSD	1.10	1.11	1.13	1.13
→ China				
PIB	4,7%/2Q24	4.80%	4.50%	4.20%

*Fuente: Bloomberg
 ** Consenso analistas
 *** Al 30 de septiembre de 2024

Colombia: Comportamiento mercado local

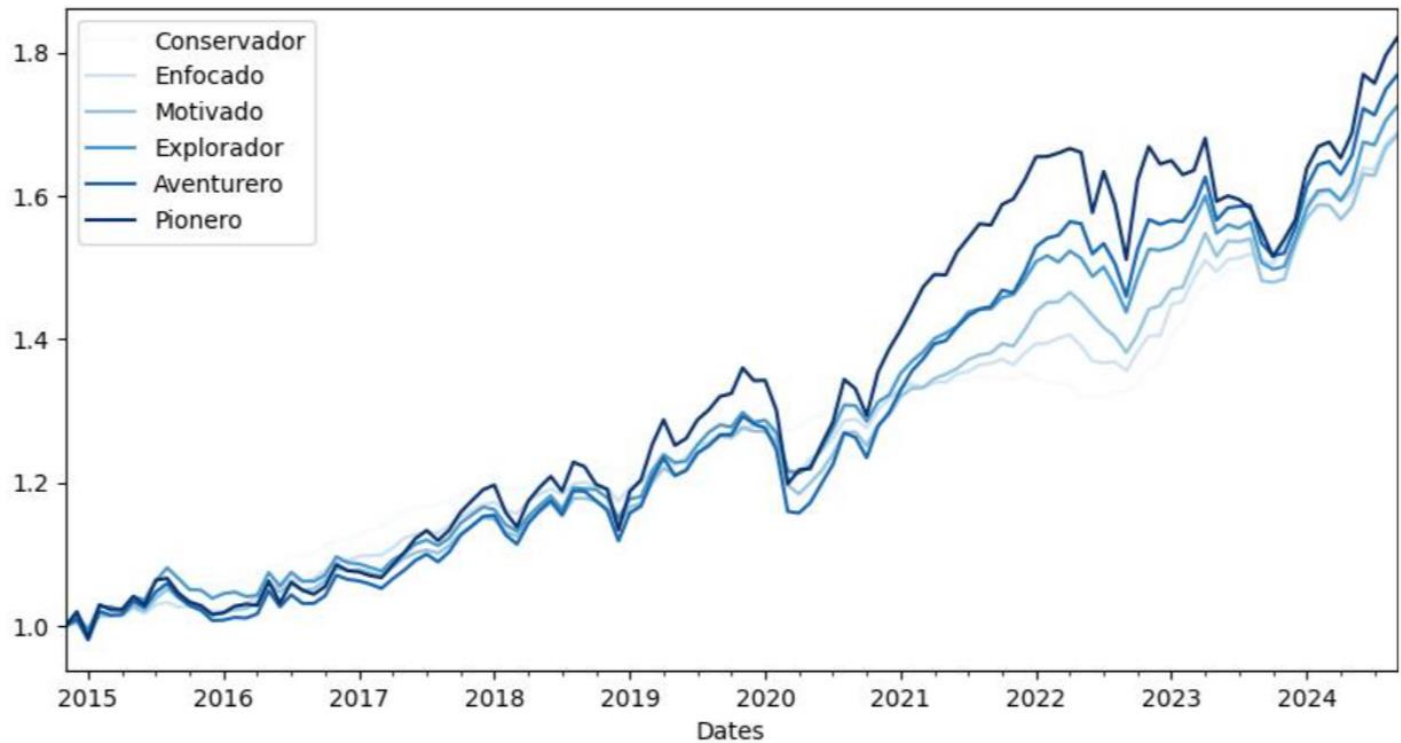
Performance	2024	sep-24		
Activos Locales	YTD	Last Month	Last Semester	2023
→ Renta Fija Local				
COLTES TF	7.85%	1.24%	9.50%	29.62%
COLTES TF CP	9.02%	1.11%	7.70%	20.01%
COLTES TF LP	7.18%	1.30%	10.32%	35.60%
COLTES UVR	2.73%	0.72%	7.12%	35.33%
COLTES UVR CP	6.74%	0.30%	5.17%	19.64%
COLTES UVR LP	1.61%	0.89%	8.04%	42.15%
GLOBAL X TES COLOMBIA	5.35%	2.29%	10.63%	
→ Renta Variable Local				
MSCI COLCAP	6.45%	-3.51%	-5.26%	-6.91%
GLOBAL X Colombia Select	9.74%	-3.07%	-6.15%	5.85%
GLOBAL X MSCI Colombia ETF	2.24%	-1.05%	-7.12%	24.92%
→ Moneda				
Peso Colombiano	-7.85%	-0.41%	-7.31%	20.13%

Colombia: Tabla de proyecciones, principales variables macro**

	HOY	2024	2025	2026
Tasa de intervención - Banrep	10.25%	8.75%	5.50%	5.50%
IPC	6.12%	5.70%	4.00%	3.50%
PIB	2.1%/2Q24	1.70%	2.60%	3.00%
USDCOP	4188	4200	4105	4000

Desempeño Carteras Modelo – Allianz

(Cierre Septiembre 2024)



	Perfil Conservador	Perfil Enfocado	Perfil Motivado	Perfil Explorador	Perfil Aventurero	Perfil Pionero
Rentabilidad 5 años	5,69	5,90	5,90	6,13	6,90	6,63
Rentabilidad Desde el inicio	5,40	5,47	5,44	5,70	5,97	6,28
Volatilidad 5 años	2,27	3,36	4,67	5,26	6,48	8,24
Máxima Caída Observada (5Y)	-2,47	-5,01	-7,23	-6,57	-10,44	-11,91
Comisión (E.A.)	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 !