

Reporte Carteras Modelo

Septiembre 2024



Internacional: Comportamiento mercado internacional

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

ACTIVOS INTERNACIONALES

	2024	ago-24		
Activos Internacionales	YTD	Last Month	Last Semester	2023
→ Renta Fija Global				
RF EE.UU.	3.60%	-0.10%	4.96%	5.53%
RF Mundial Soberana	1.83%	0.01%	3.92%	4.35%
RF Mundial Corporativa	4.24%	0.89%	4.96%	9.61%
RF Emergente	6.74%	1.93%	6.10%	9.09%
→ Renta Variable Global				
Acciones EE.UU.	20.08%	8.95%	10.33%	26.31%
Acciones Emergentes	9.89%	7.30%	6.93%	8.95%
Acciones Japon	14.07%	13.46%	2.62%	20.29%
Acciones Asia Pacifico	7.99%	10.41%	8.98%	5.76%
Acciones Europa	13.79%	9.28%	8.26%	20.14%
→ Commodities				
Indice Commodity Compuesto	-2.05%	2.32%	-3.60%	-12.55%
WTI	4.92%	1.87%	-6.53%	-2.74%
Brent	3.19%	1.28%	-6.79%	-2.71%
Gold	21.59%	3.84%	15.88%	13.10%
→ Monedas y otros				
Indice Bloomberg Dólar	1.04%	-0.91%	-0.29%	-2.70%
DXY	-0.49%	-0.97%	-1.82%	-2.11%
Dólar Mercados Emergentes	-4.07%	0.48%	-1.84%	-3.75%

Internacional: Tabla de proyecciones, principales variables macro**

	HOY	2024	2025	2026
→ EE.UU.				
FED funds rate (Upper Bound)	5.50%	4.75%	3.50%	3.25%
IPC	2.90%	2.90%	2.30%	2.30%
PIB	3.0%/2Q24	2.50%	1.70%	2.00%
→ Euro				
ECB Reference rate	4.50%	3.40%	2.50%	2.50%
IPC	2.20%	2.40%	2.10%	2.00%
PIB	0,6%/2Q24	0.70%	1.40%	1.30%
EURUSD	1.1	1.1	1.12	1.14
→ China				
PIB	4,7%/2Q24	4.80%	4.50%	4.30%

Colombia: Comportamiento mercado local

*Fuente: Bloomberg
 ** Consenso analistas
 *** Al 31 de agosto de 2024

ACTIVOS LOCALES

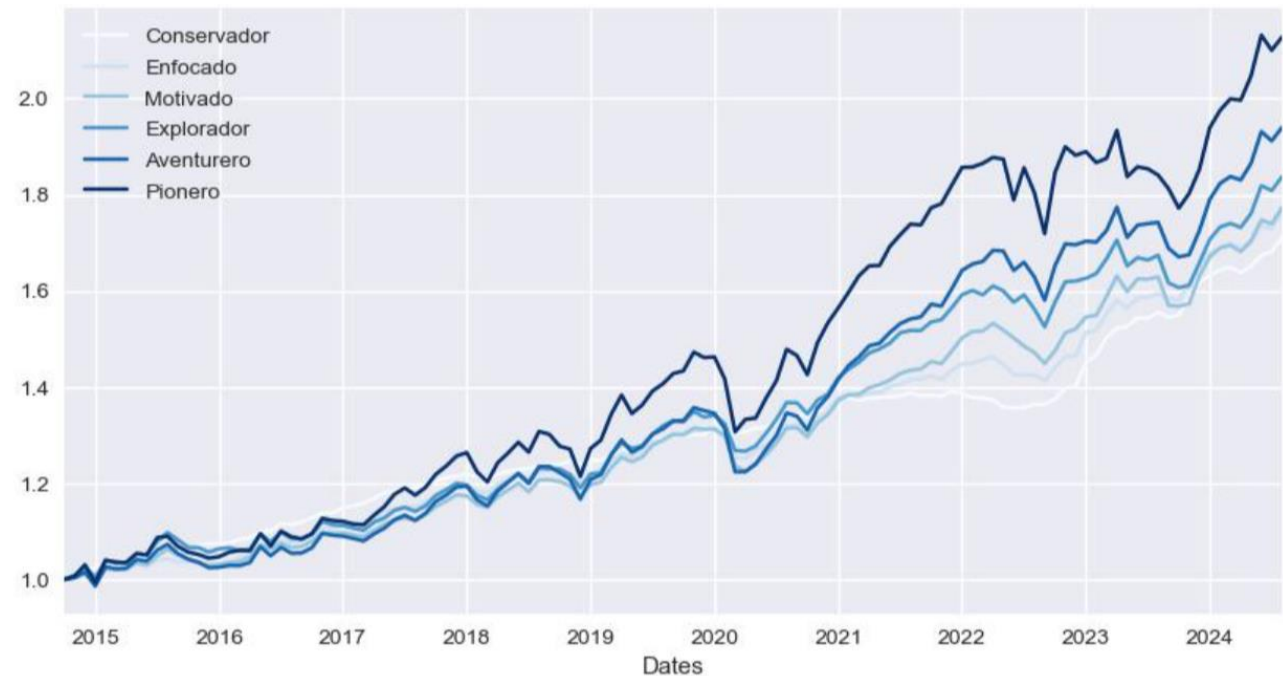
Performance	2024	ago-24		
Activos Locales	YTD	Last Month	Last Semester	2023
→ Renta Fija Local				
COLTES TF	6.79%	2.61%	5.08%	29.62%
COLTES TF CP	7.79%	1.04%	5.08%	20.01%
COLTES TF LP	6.19%	3.31%	5.00%	35.60%
COLTES UVR	1.56%	3.13%	3.90%	35.33%
COLTES UVR CP	6.14%	0.51%	4.60%	19.64%
COLTES UVR LP	0.20%	4.31%	3.86%	42.15%
GLOBAL X TES COLOMBIA	3.87%	4.17%		
→ Renta Variable Local				
MSCI COLCAP	11.43%	5.23%	4.22%	-6.91%
GLOBAL X Colombia Select	12.91%	3.49%	4.51%	5.85%
GLOBAL X MSCI Colombia ETF	3.59%	3.31%	-0.18%	24.92%
→ Moneda				
Peso Colombiano	-7.73%	-0.51%	-7.26%	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	6.86%	5.70%	4.00%	3.50%
PIB	2.1%/2Q24	1.70%	2.60%	3.00%
USDCOP	4160	4118	4100	4000

Desempeño Carteras Modelo – Allianz

(Cierre Agosto 2024)



	Perfil Conservador	Perfil Enfocado	Perfil Motivado	Perfil Explorador	Perfil Aventurero	Perfil Pionero
Rentabilidad 5 años	5,80	6,46	6,56	6,85	8,12	8,63
Rentabilidad Desde el inicio	5,62	5,93	6,00	6,38	6,97	7,98
Volatilidad 5 años	2,38	3,35	4,62	5,21	6,41	8,13
Máxima Caída Observada (5Y)	-2,53	-4,87	-6,84	-6,12	-9,83	-11,27
Comisión (E.A.)	0,02	0,02	0,03	0,03	0,03	0,03

*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 !