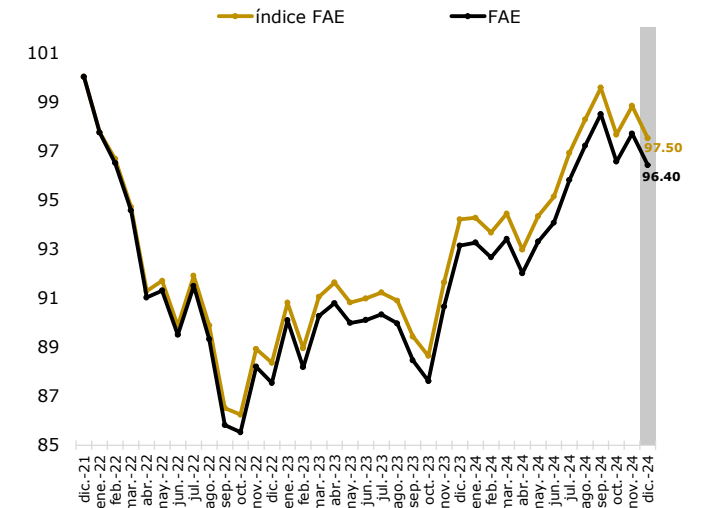


FONDO DE AHORRO Y ESTABILIZACIÓN - FAE

INFORME: DICIEMBRE 2024

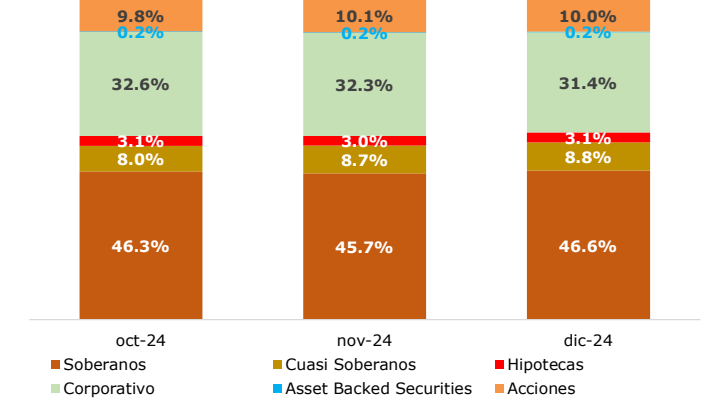
Comportamiento del Fondo

(Base 100 = 31 Dic 2021)



Estadísticas	31-oct-24	30-nov-24	31-dic-24	Variación
Activos Netos (USD Millones)	4,395	4,421	4,403	-0.40%
Valor Unidad (USD \$)	1,189	1,194	1,188	-0.50%
Activos Portafolio (USD Millones)	1,666	1,692	1,675	-1.04%
Volatilidad Mensual	2.31%	2.22%	1.77%	-20.24%
Volatilidad 12 meses	1.61%	1.39%	1.32%	-4.92%
Treynor Ratio	0.19	0.09	-0.04	-140.61%
Sharpe Ratio	3.35	2.20	-0.88	-140.08%
Beta	0.36	0.34	0.32	-6.16%
Duración	4.47	4.52	4.45	-1.55%
Vencimiento Medio	6.93	6.92	6.87	-0.72%
Rentabilidad*	31-oct-24	30-nov-24	31-dic-24	Variación
Mensual	-1.96%	1.18%	-1.32%	-211.87%
12 Meses	10.21%	7.78%	3.51%	-54.88%
2 Años Anualizada	6.25%	5.24%	4.94%	-5.74%
3 Años Anualizada	-1.11%	-0.73%	-1.21%	-65.43%

Composición*



Fuente: Banrep, Bloomberg, Cálculos Grupo Financiero Asesor

TOP 10 Mayores Posiciones %**	
MONEY MARKET FUND	6.18%
USA TREASURY 4.625% 15/10/2026	2.27%
USA TREASURY 4.375% 15/05/2034	1.48%
USA TREASURY 2.375% 15/05/2027	1.35%
USA TREASURY 2.375% 30/04/2026	1.27%
USA TREASURY 2.75% 30/04/2027	1.19%
USA TREASURY 4.125% 15/06/2026	1.16%
USA TREASURY 2.25% 15/02/2027	1.14%
USA TREASURY 3.75% 30/06/2030	1.11%
USA TREASURY 4.625% 28/02/2026	1.07%
TOTAL	18.21%

*Las estadísticas solo reflejan el comportamiento de los activos bajo administración, no incluye los pagarés de la Nación.

** Incluye los activos de renta fija que hacen parte de los activos bajo administración.