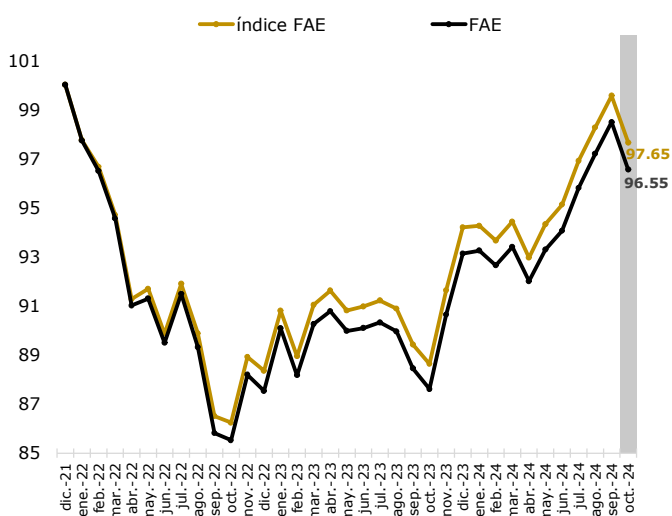


FONDO DE AHORRO Y ESTABILIZACIÓN - FAE INFORME: OCTUBRE 2024

Comportamiento del Fondo (Base 100 = 31 Dic 2021)



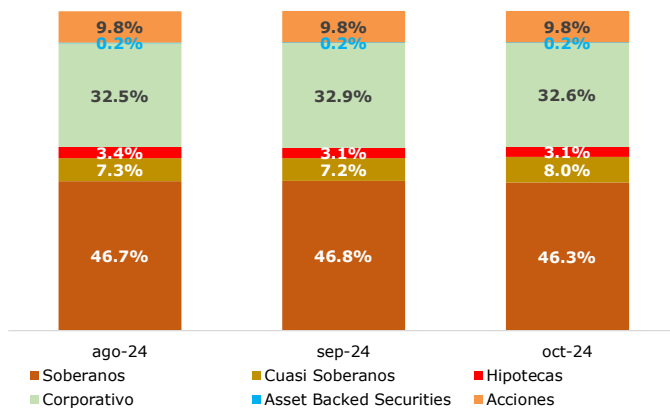
Estadísticas

Estadísticas	31-ago-24	30-sep-24	31-oct-24	Variación
Activos Netos (USD Millones)	4,390	4,422	4,395	-0.63%
Valor Unidad (USD \$)	1,192	1,198	1,189	-0.75%
Activos Portafolio (USD Millones)	1,661	1,694	1,666	-1.64%
Volatilidad Mensual	0.28%	0.11%	2.31%	2096.77%
Volatilidad 12 meses	1.64%	1.47%	1.61%	9.38%
Treynor Ratio	0.11	0.20	0.15	-23.47%
Sharpe Ratio	1.84	4.37	3.35	-23.19%
Beta	0.32	0.33	0.36	9.78%
Duración	4.72	4.80	4.47	-6.88%
Vencimiento Medio	7.41	7.34	6.93	-5.59%

Rentabilidad*

Rentabilidad*	31-ago-24	30-sep-24	31-oct-24	Variación
Mensual	1.46%	1.31%	-1.96%	-248.92%
12 Meses	8.05%	11.33%	10.21%	-9.96%
2 Años Anualizada	4.32%	7.12%	6.25%	-12.19%
3 Años Anualizada	-1.18%	-0.34%	-1.11%	-229.63%

Composición*



TOP 10 Mayores Posiciones %**

MONEY MARKET FUND	5.20%
USA TREASURY 4.625% 15/10/2026	2.27%
USA TREASURY 4.375% 15/05/2034	1.84%
USA TREASURY 2.375% 15/05/2027	1.37%
USA TREASURY 2.375% 30/04/2026	1.26%
USA TREASURY 2.75% 30/04/2027	1.19%
USA TREASURY 4.125% 15/06/2026	1.18%
USA TREASURY 4% 15/02/2026	1.17%
USA TREASURY 3.75% 30/06/2030	1.14%
USA TREASURY 2.25% 15/02/2027	1.14%
TOTAL	17.76%

Fuente: Banrep, Bloomberg, Cálculos Grupo Financiero Asesor

*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.