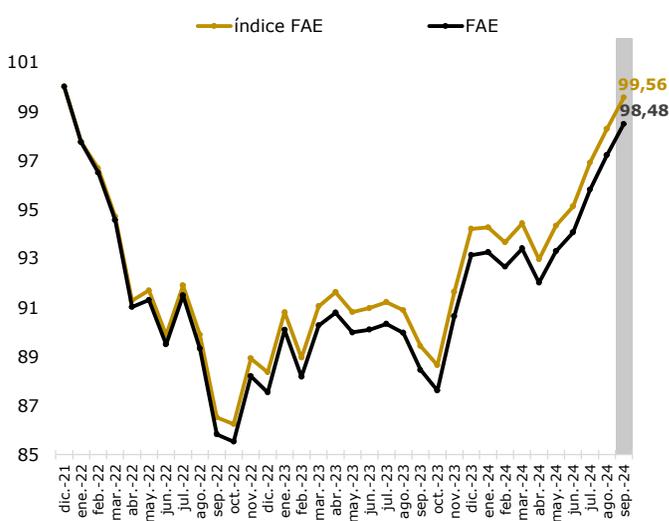


## FONDO DE AHORRO Y ESTABILIZACIÓN - FAE

### INFORME: SEPTIEMBRE 2024

#### Comportamiento del Fondo (Base 100 = 31 Dic 2021)



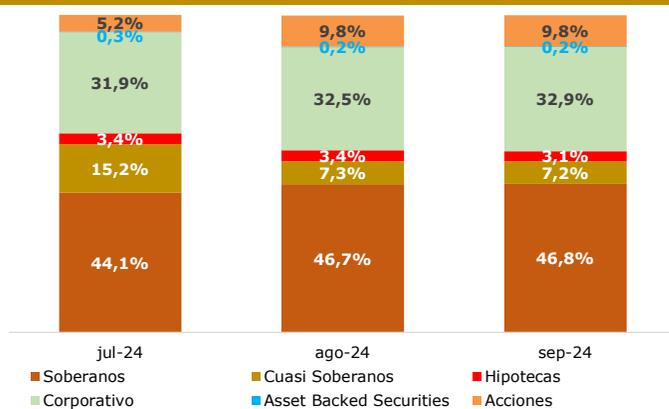
#### Estadísticas

	31-jul-24	31-ago-24	30-sep-24	Variación
Activos Netos (USD Millones)	4.341	4.390	4.422	0,75%
Valor Unidad (USD \$)	1.185	1.192	1.198	0,50%
Activos Portafolio (USD Millones)	1.613	1.661	1.694	1,97%
Volatilidad Mensual	0,74%	0,28%	0,11%	-62,52%
Volatilidad 12 meses	1,64%	1,64%	1,47%	-10,31%
Treynor Ratio	0,03	0,09	0,20	110,82%
Sharpe Ratio	0,58	1,84	4,37	137,21%
Beta	0,32	0,32	0,33	0,92%
Duración	4,67	4,72	4,80	1,69%
Vencimiento Medio	7,09	7,41	7,34	-0,94%

#### Rentabilidad\*

	31-jul-24	31-ago-24	30-sep-24	Variación
Mensual	1,86%	1,46%	1,31%	-10,18%
12 Meses	6,07%	8,05%	11,33%	40,79%
2 Años Anualizada	2,33%	4,32%	7,12%	64,88%
3 Años Anualizada	-1,62%	-1,18%	-0,34%	71,47%

#### Composición\*



#### TOP 10 Mayores Posiciones %\*\*

MONEY MARKET FUND	4,32%
USA TREASURY 4,625% 15/10/2026	2,30%
USA TREASURY 4% 15/02/2026	1,98%
USA TREASURY 4,375% 15/05/2034	1,88%
USA TREASURY 2,375% 15/05/2027	1,36%
USA TREASURY 2,375% 30/04/2026	1,26%
USA TREASURY 2,75% 30/04/2027	1,20%
USA TREASURY 4,125% 15/06/2026	1,17%
USA TREASURY 3,75% 30/06/2030	1,15%
USA TREASURY 2,25% 15/02/2027	1,13%

#### TOTAL

**17,75%**

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.