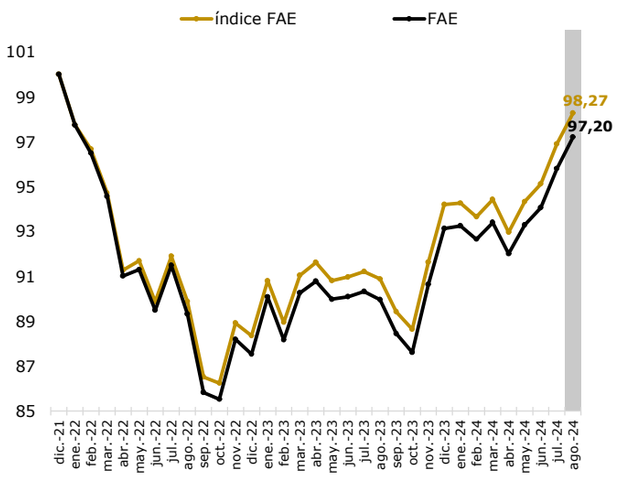
FONDO DE AHORRO Y ESTABILIZACIÓN - FAE

INFORME: AGOSTO 2024

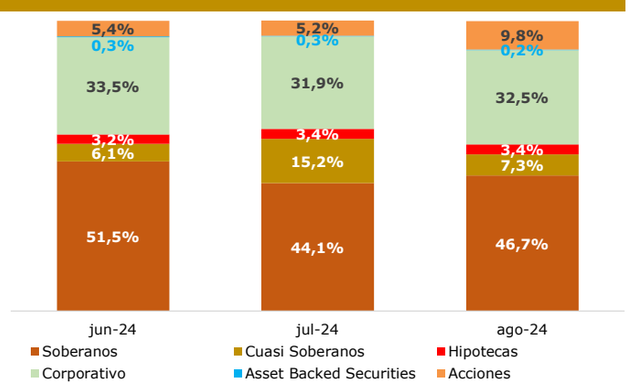
Comportamiento del Fondo (Base 100 = 31 Dic 2021)



Estadísticas	30-jun-24	31-jul-24	31-ago-24	Variación
Activos Netos (USD Millones)	4.312	4.341	4.390	1,12%
Valor Unidad (USD $)	1.177	1.185	1.192	0,54%
Activos Portafolio (USD Millones)	1.583	1.613	1.661	3,02%
Volatilidad Mensual	0,41%	0,74%	0,28%	-61,89%
Volatilidad 12 meses	1,59%	1,64%	1,64%	-0,33%
Treynor Ratio	-0,03	0,03	0,09	210,37%
Sharpe Ratio	-0,48	0,58	1,84	218,78%
Beta	0,29	0,32	0,32	2,37%
Duración	4,29	4,67	4,72	1,07%
Vencimiento Medio	6,57	7,09	7,41	4,51%

Rentabilidad*	30-jun-24	31-jul-24	31-ago-24	Variación
Mensual	0,82%	1,86%	1,46%	-21,36%
12 Meses	4,39%	6,07%	8,05%	32,75%
2 Años Anualizada	2,51%	2,33%	4,32%	85,22%
3 Años Anualizada	-1,93%	-1,62%	-1,18%	27,53%

Composición*



TOP 10 Mayores Posiciones %**

MONEY MARKET FUND	4,56%
USA TREASURY 4,625% 15/10/2026	2,32%
USA TREASURY 4% 15/02/2026	2,00%
USA TREASURY 2,375% 15/05/2027	1,37%
USA TREASURY 2,375% 30/04/2026	1,28%
USA TREASURY 2,75% 30/04/2027	1,21%
USA TREASURY 4,125% 15/06/2026	1,18%
USA TREASURY 2,25% 15/02/2027	1,14%
USA TREASURY 4% 15/01/2027	1,10%
USA TREASURY 4,625% 28/02/2026	1,09%
TOTAL	**17,26%**

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.