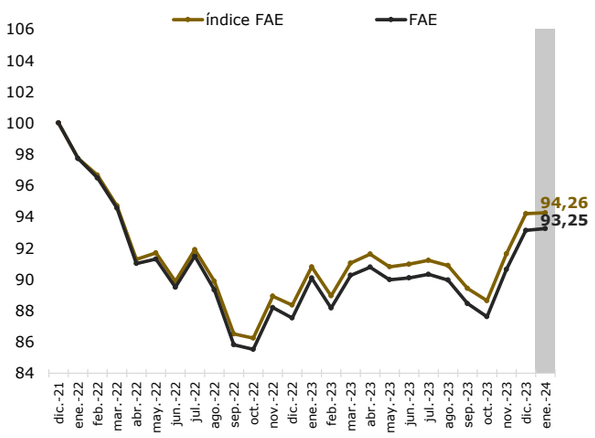
FONDO DE AHORRO Y ESTABILIZACIÓN - FAE

INFORME: ENERO 2024

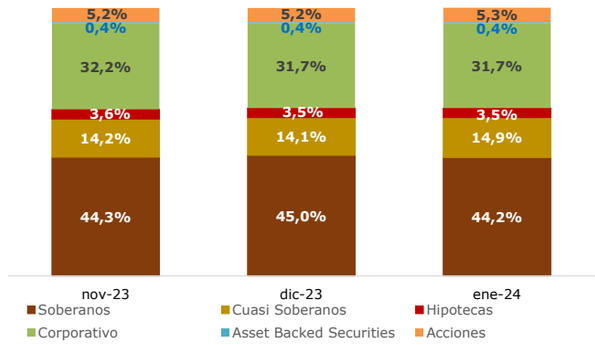
Comportamiento del Fondo (Base 100 = 31 Dic 2021)



Estadísticas	30-nov-23	31-dic-23	31-ene-24	Variación
Activos Netos (USD Millones)	4.163	4.209	4.219	0,25%
Valor Unidad (USD $)	1.162	1.173	1.174	0,04%
Activos Portafolio (USD Millones)	1.434	1.480	1.491	0,71%
Volatilidad Mensual	3,12%	0,50%	1,86%	272,81%
Volatilidad 12 meses	1,80%	1,90%	1,75%	-8,06%
Treynor Ratio	-0,07	-0,07	-0,04	40,30%
Sharpe Ratio	-1,25	-1,20	-0,88	26,13%
Beta	0,34	0,33	0,38	13,76%
Duración	4,18	4,13	4,05	-1,94%
Vencimiento Medio	6,09	5,99	6,01	0,33%

Rentabilidad*	30-nov-23	30-nov-23	31-ene-24	Variación
Mensual	3,46%	3,46%	0,12%	-96,42%
12 Meses	2,77%	2,77%	3,51%	26,77%
2 Años Anualizada	-4,74%	-4,74%	-2,32%	50,97%
3 Años Anualizada	-2,90%	-2,90%	-1,89%	34,74%

Composición*



Fuente: Banrep, Bloomberg, Cálculos Grupo Financiero Asesor

TOP 10 Mayores Posiciones %**

MONEY MARKET FUND	11,30%
USA TREASURY 4.625% 30/06/2025	5,34%
USA TREASURY 1.875% 30/06/2026	3,80%
USA TREASURY 4.625% 15/10/2026	2,45%
USA TREASURY 0.375% 30/04/2025	1,35%
USA TREASURY 2.375% 30/04/2026	1,34%
USA TREASURY 4.125% 15/06/2026	1,25%
USA TREASURY 3.5% 15/02/2033	1,16%
USA TREASURY 4% 29/02/2028	1,11%
USA TREASURY 0.75% 31/03/2026	1,05%
TOTAL	**30,14%**

*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.