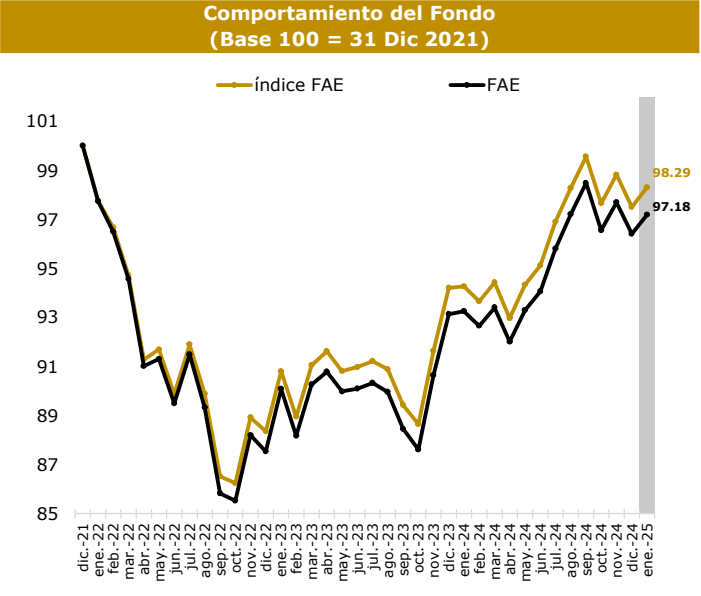
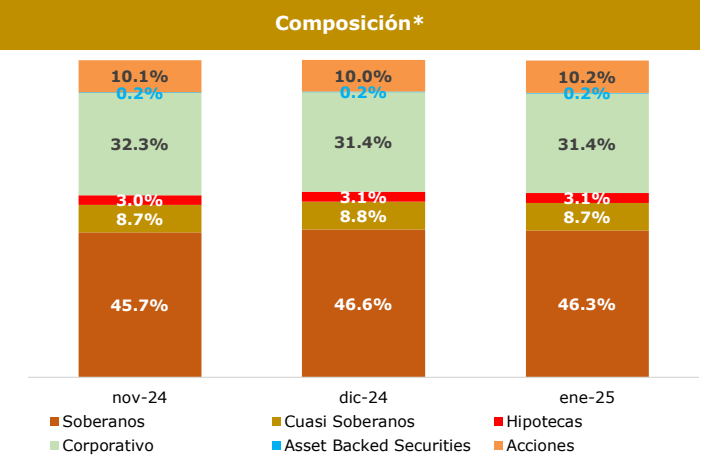


FONDO DE AHORRO Y ESTABILIZACIÓN - FAE

INFORME: ENERO 2025



Estadísticas	30-nov-24	31-dic-24	31-ene-25	Variación
Activos Netos (USD Millones)	4,421	4,403	4,417	0.31%
Valor Unidad (USD \$)	1,194	1,188	1,192	0.31%
Activos Portafolio (USD Millones)	1,692	1,675	1,668	-0.38%
Volatilidad Mensual	2.22%	1.77%	1.51%	-14.82%
Volatilidad 12 meses	1.39%	1.32%	1.33%	0.51%
Treynor Ratio	0.11	-0.04	-0.01	61.48%
Sharpe Ratio	2.20	-0.88	-0.30	66.01%
Beta	0.34	0.32	0.28	-11.30%
Duración	4.52	4.45	4.30	-3.37%
Vencimiento Medio	6.92	6.87	6.63	-3.49%
Rentabilidad*	30-nov-24	31-dic-24	31-ene-25	Variación
Mensual	1.18%	-1.32%	0.81%	161.32%
12 Meses	7.78%	3.51%	4.22%	20.20%
2 Años Anualizada	5.24%	4.94%	3.86%	-21.84%
3 Años Anualizada	-0.73%	-1.21%	-0.19%	84.48%



Fuente: Banrep, Bloomberg, Cálculos Grupo Financiero Asesor

TOP 10 Mayores Posiciones %**	
MONEY MARKET FUND	6.85%
USA TREASURY 4.625% 15/10/2026	2.29%
USA TREASURY 4.375% 15/05/2034	1.48%
USA TREASURY 2.375% 15/05/2027	1.36%
USA TREASURY 2.375% 30/04/2026	1.28%
USA TREASURY 2.75% 30/04/2027	1.20%
USA TREASURY 4.125% 15/06/2026	1.17%
USA TREASURY 2.25% 15/02/2027	1.14%
USA TREASURY 3.75% 30/06/2030	1.10%
USA TREASURY 4.625% 28/02/2026	1.08%
TOTAL	18.93%

*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.