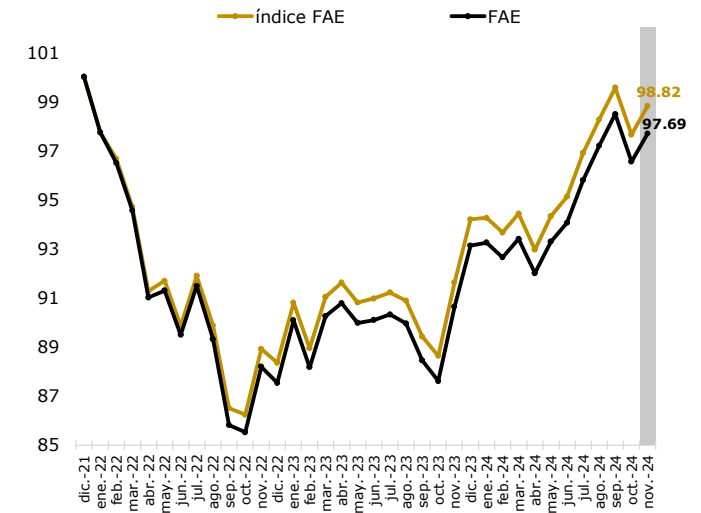


FONDO DE AHORRO Y ESTABILIZACIÓN - FAE

INFORME: NOVIEMBRE 2024

Comportamiento del Fondo

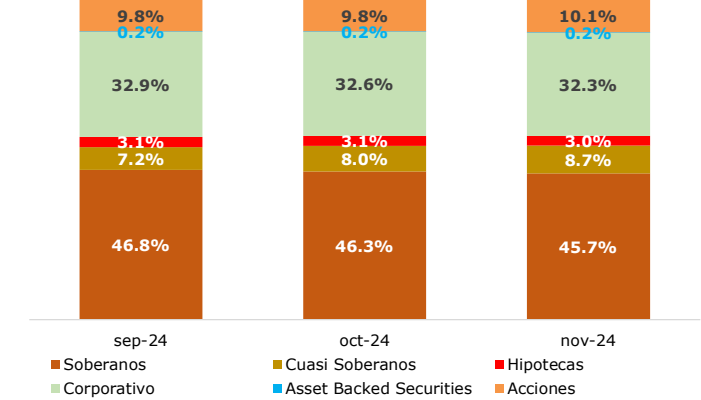
(Base 100 = 31 Dic 2021)



Estadísticas	30-sep-24	31-oct-24	30-nov-24	Variación
Activos Netos (USD Millones)	4,422	4,395	4,421	0.59%
Valor Unidad (USD \$)	1,198	1,189	1,194	0.45%
Activos Portafolio (USD Millones)	1,694	1,666	1,692	1.57%
Volatilidad Mensual	0.11%	2.31%	2.22%	-4.06%
Volatilidad 12 meses	1.47%	1.61%	1.39%	-13.66%
Treynor Ratio	0.23	0.15	0.09	-40.40%
Sharpe Ratio	4.37	3.35	2.20	-34.50%
Beta	0.33	0.36	0.34	-5.12%
Duración	4.80	4.47	4.52	1.12%
Vencimiento Medio	7.34	6.93	6.92	-0.14%

Rentabilidad*	30-sep-24	31-oct-24	30-nov-24	Variación
Mensual	1.31%	-1.96%	1.18%	160.37%
12 Meses	11.33%	10.21%	7.78%	-23.75%
2 Años Anualizada	7.12%	6.25%	5.24%	-16.09%
3 Años Anualizada	-0.34%	-1.11%	-0.73%	33.68%

Composición*



Fuente: Banrep, Bloomberg, Cálculos Grupo Financiero Asesor

TOP 10 Mayores Posiciones %**	
MONEY MARKET FUND	6.17%
USA TREASURY 4.625% 15/10/2026	2.25%
USA TREASURY 4.375% 15/05/2034	1.51%
USA TREASURY 2.375% 15/05/2027	1.34%
USA TREASURY 2.375% 30/04/2026	1.25%
USA TREASURY 2.75% 30/04/2027	1.18%
USA TREASURY 4.125% 15/06/2026	1.17%
USA TREASURY 3.75% 30/06/2030	1.13%
USA TREASURY 2.25% 15/02/2027	1.13%
USA TREASURY 4% 15/01/2027	1.08%
TOTAL	18.20%

*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.