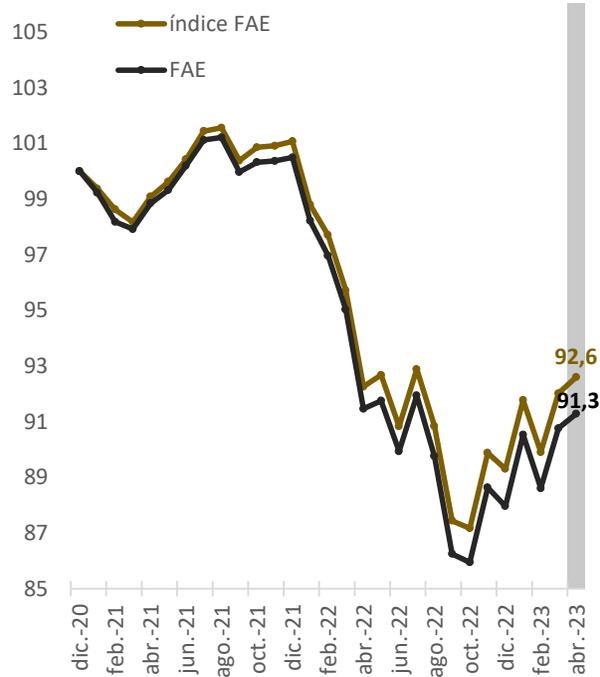


FONDO DE AHORRO Y ESTABILIZACIÓN - FAE

INFORME: ABRIL 2023

Comportamiento del Fondo (Base 100 = 31 Dic 2020)



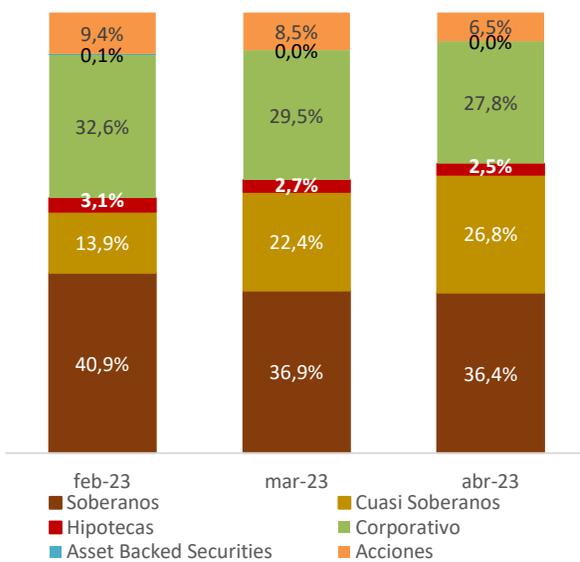
Estadísticas

| Estadísticas | 28-feb-23 | 31-mar-23 | 30-abr-23 | Variación |
|------------------------------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| Activos Netos (USD Millones) | 3.646,5 | 3.678,9 | 3.694,5 | 0,4% |
| Valor Unidad (USD \$) | 1.154,9 | 1.160,3 | 1.161,9 | 0,1% |
| Volatilidad Mensual | 3,57% | 3,22% | 1,32% | -59,2% |
| Volatilidad 12 meses | 2,43% | 2,56% | 2,33% | -8,9% |
| Sharpe Ratio | -4,80 | -3,11 | -1,69 | 45,5% |
| Beta | 0,28 | 0,30 | 0,32 | 7,6% |
| Duración | 4,48 | 4,12 | 4,52 | 9,7% |
| Vencimiento Medio | 6,76 | 6,05 | 6,51 | 7,6% |

Rentabilidad*

| Rentabilidad* | 28-feb-23 | 31-mar-23 | 30-abr-23 | Variación |
|-------------------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| Mensual | -2,13% | 2,44% | 0,58% | -76,4% |
| 12 Meses | -8,62% | -4,49% | -0,19% | 95,7% |
| 2 Años Anualizada | -5,00% | -3,72% | -3,90% | -4,7% |
| 3 Años Anualizada | -1,86% | -0,44% | -1,23% | -177,1% |

Composición*



TOP 10 Mayores Posiciones %**

| | |
|---|---------------|
| MONEY MARKET FUND | 28,52% |
| USA TREASURY 0,375% 30/04/2025 | 3,94% |
| USA TREASURY 2,375% 30/04/2026 | 2,21% |
| USA TREASURY 2,5% 15/05/2024 | 1,71% |
| USA TREASURY 2,125% 30/11/2024 | 1,60% |
| USA TREASURY 2,875% 31/05/2025 | 1,45% |
| FEDERAL NATIONAL MORTGAGE 2% 01/03/2052 | 1,45% |
| USA TREASURY 0,25% 15/06/2024 | 1,32% |
| USA TREASURY 2,875% 30/04/2025 | 1,32% |
| USA TREASURY 1,875% 31/08/2024 | 1,22% |
| TOTAL | 44,76% |

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.