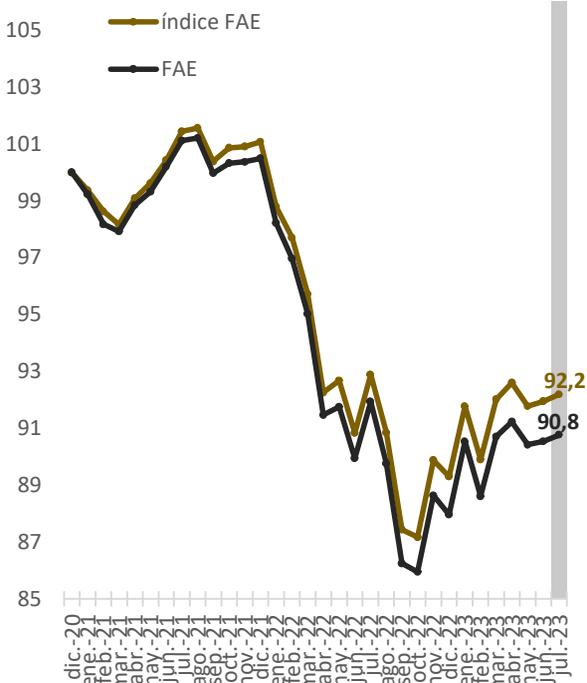


## FONDO DE AHORRO Y ESTABILIZACIÓN - FAE

INFORME: JULIO 2023

### Comportamiento del Fondo (Base 100 = 31 Dic 2020)



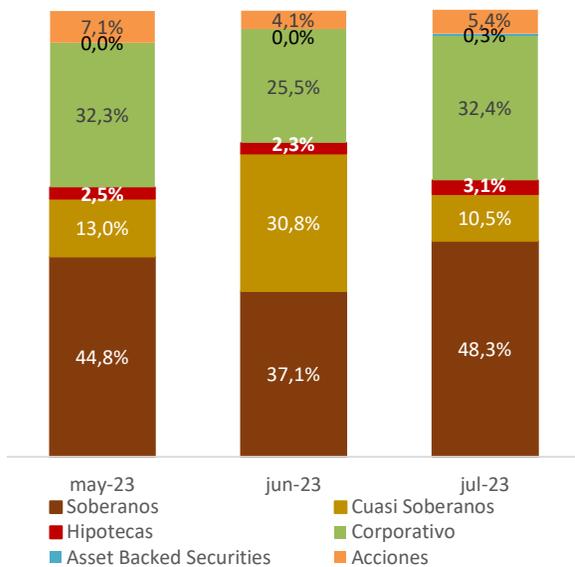
### Estadísticas

| Estadísticas                 | 31-may-23 | 30-jun-23 | 31-jul-23 | Variación |
|------------------------------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| Activos Netos (USD Millones) | 3.695,8   | 4.114,1   | 4.126,0   | 0,29%     |
| Valor Unidad (USD \$)        | 1.159,2   | 1.159,6   | 1.160,6   | 0,09%     |
| Volatilidad Mensual          | 1,03%     | 0,72%     | 0,09%     | -87,80%   |
| Volatilidad 12 meses         | 2,33%     | 2,26%     | 2,16%     | -4,47%    |
| Treynor Ratio                | -0,18     | -0,13     | -0,19     | -51,10%   |
| Sharpe Ratio                 | -2,35     | -1,61     | -2,69     | -67,43%   |
| Beta                         | 0,30      | 0,28      | 0,30      | 5,86%     |
| Duración                     | 4,45      | 4,52      | 4,42      | -2,21%    |
| Vencimiento Medio            | 6,47      | 6,50      | 6,44      | -0,92%    |

### Rentabilidad\*

| Rentabilidad*     | 31-may-23 | 30-jun-23 | 31-jul-23 | Variación |
|-------------------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| Mensual           | -0,88%    | 0,13%     | 0,25%     | 95,42%    |
| 12 Meses          | -1,45%    | 0,67%     | -1,27%    | -290,40%  |
| 2 Años Anualizada | -4,58%    | -4,94%    | -5,26%    | -6,32%    |
| 3 Años Anualizada | -1,90%    | -2,18%    | -2,71%    | -24,57%   |

### Composición\*



### TOP 10 Mayores Posiciones %\*\*

|                                |       |
|--------------------------------|-------|
| MONEY MARKET FUND              | 6,83% |
| USA TREASURY 4,625% 30/06/2025 | 5,66% |
| USA TREASURY 1,875% 31/08/2024 | 3,77% |
| USA TREASURY 0,375% 30/04/2025 | 2,51% |
| USA TREASURY 1,875% 30/06/2026 | 2,41% |
| USA TREASURY 3,5% 15/02/2033   | 1,72% |
| USA TREASURY 0% 19/10/2023     | 1,68% |
| USA TREASURY 2,375% 30/04/2026 | 1,40% |
| USA TREASURY 4,125% 15/06/2026 | 1,32% |
| USA TREASURY 2,125% 30/11/2024 | 1,01% |

TOTAL

28,30%

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.