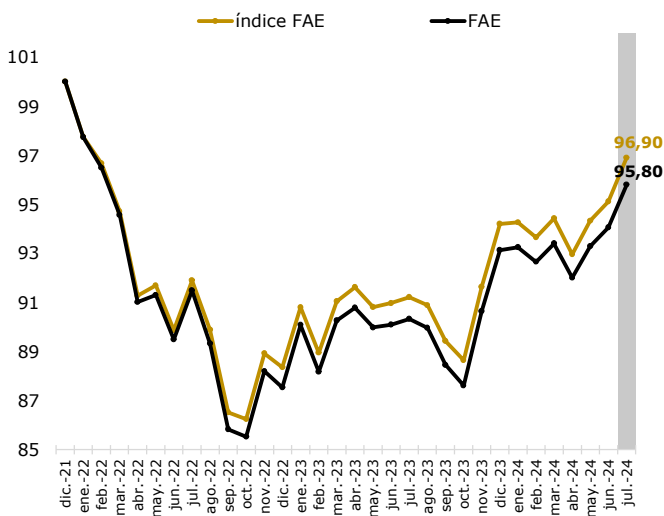


FONDO DE AHORRO Y ESTABILIZACIÓN - FAE INFORME: JULIO 2024

Comportamiento del Fondo (Base 100 = 31 Dic 2021)



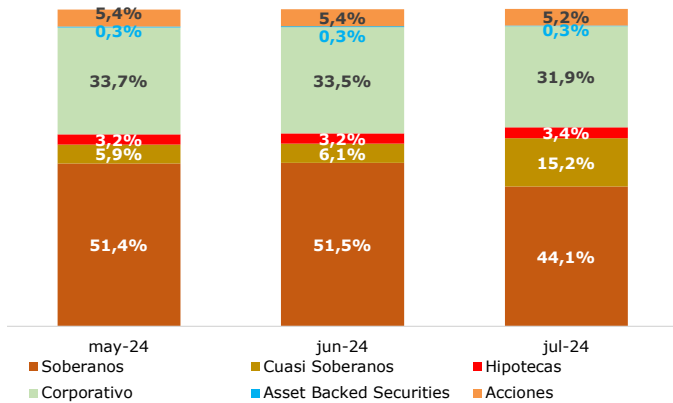
Estadísticas

	31-may-24	30-jun-24	31-jul-24	Variación
Activos Netos (USD Millones)	4.299	4.312	4.341	0,68%
Valor Unidad (USD \$)	1.174	1.177	1.185	0,68%
Activos Portafolio (USD Millones)	1.570	1.583	1.613	1,86%
Volatilidad Mensual	2,04%	0,41%	0,74%	79,62%
Volatilidad 12 meses	1,58%	1,59%	1,64%	3,52%
Treynor Ratio	-0,05	-0,03	0,03	213,40%
Sharpe Ratio	-0,93	-0,48	0,58	220,98%
Beta	0,29	0,29	0,32	10,44%
Duración	4,31	4,29	4,67	8,86%
Vencimiento Medio	6,45	6,57	7,09	7,91%

Rentabilidad*

	31-may-24	30-jun-24	31-jul-24	Variación
Mensual	1,40%	0,82%	1,86%	127,48%
12 Meses	3,68%	4,39%	6,07%	38,05%
2 Años Anualizada	1,08%	2,51%	2,33%	-7,27%
3 Años Anualizada	-1,90%	-1,93%	-1,62%	15,79%

Composición*



TOP 10 Mayores Posiciones %**

MONEY MARKET FUND	14,10%
USA TREASURY 4,625% 15/10/2026	2,37%
USA TREASURY 4% 15/02/2026	2,09%
USA TREASURY 2,375% 15/05/2027	1,40%
USA TREASURY 2,375% 30/04/2026	1,30%
USA TREASURY 2,75% 30/04/2027	1,24%
USA TREASURY 4,125% 15/06/2026	1,21%
USA TREASURY 2,25% 15/02/2027	1,18%
USA TREASURY 4% 15/01/2027	1,12%
USA TREASURY 4,625% 28/02/2026	1,11%
TOTAL	27,11%

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.