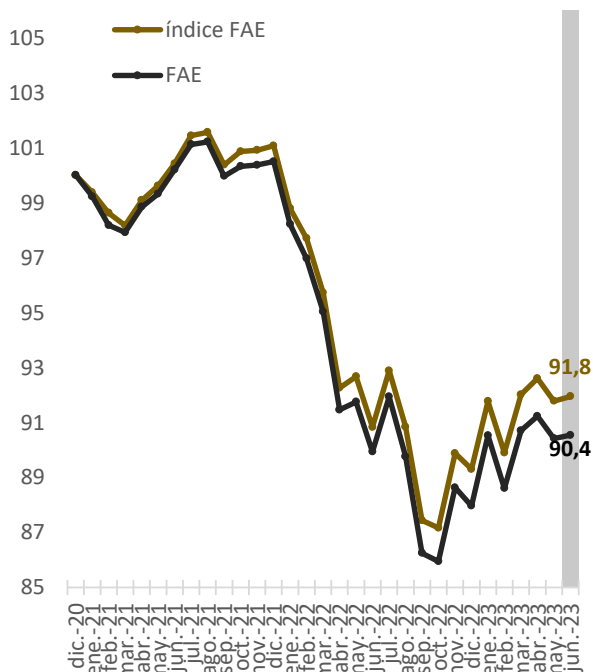


FONDO DE AHORRO Y ESTABILIZACIÓN - FAE

INFORME: JUNIO 2023

Comportamiento del Fondo (Base 100 = 31 Dic 2020)



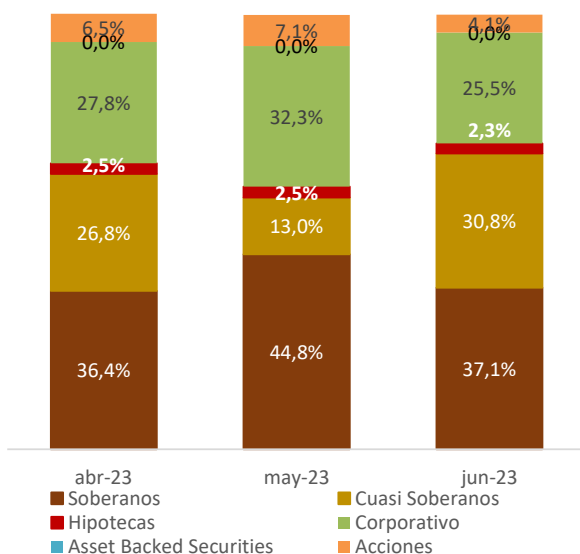
Estadísticas

| Estadísticas | 30-abr-23 | 31-may-23 | 30-jun-23 | Variación |
|------------------------------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| Activos Netos (USD Millones) | 3.694,5 | 3.695,8 | 4.114,1 | 11,32% |
| Valor Unidad (USD \$) | 1.161,9 | 1.159,2 | 1.159,6 | 0,04% |
| Volatilidad Mensual | 1,27% | 1,03% | 0,72% | -30,54% |
| Volatilidad 12 meses | 2,32% | 2,33% | 2,26% | -3,27% |
| Sharpe Ratio | -1,72 | -2,35 | -1,61 | 31,61% |
| Beta | 0,32 | 0,30 | 0,28 | -6,39% |
| Duración | 4,52 | 4,45 | 4,52 | 1,57% |
| Vencimiento Medio | 6,51 | 6,47 | 6,50 | 0,46% |

Rentabilidad*

| Rentabilidad* | 30-abr-23 | 31-may-23 | 30-jun-23 | Variación |
|-------------------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| Mensual | 0,58% | -0,88% | 0,13% | 114,66% |
| 12 Meses | -0,26% | -1,45% | 0,67% | 146,13% |
| 2 Años Anualizada | -3,93% | -4,58% | -4,94% | -7,83% |
| 3 Años Anualizada | -1,25% | -1,90% | -2,18% | -14,35% |

Composición*



TOP 10 Mayores Posiciones %**

| | |
|--------------------------------|--------|
| MONEY MARKET FUND | 37,92% |
| USA TREASURY 4,625% 30/06/2025 | 5,69% |
| USA TREASURY 1,875% 31/08/2024 | 4,37% |
| USA TREASURY 0,375% 30/04/2025 | 2,52% |
| USA TREASURY 1,875% 30/06/2026 | 2,42% |
| USA TREASURY 3,5% 15/02/2033 | 1,74% |
| USA TREASURY 2,375% 30/04/2026 | 1,41% |
| USA TREASURY 4,125% 15/06/2026 | 1,32% |
| USA TREASURY 2,125% 30/11/2024 | 1,01% |
| USA TREASURY 2,875% 31/05/2025 | 0,92% |

TOTAL

59,32%

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.