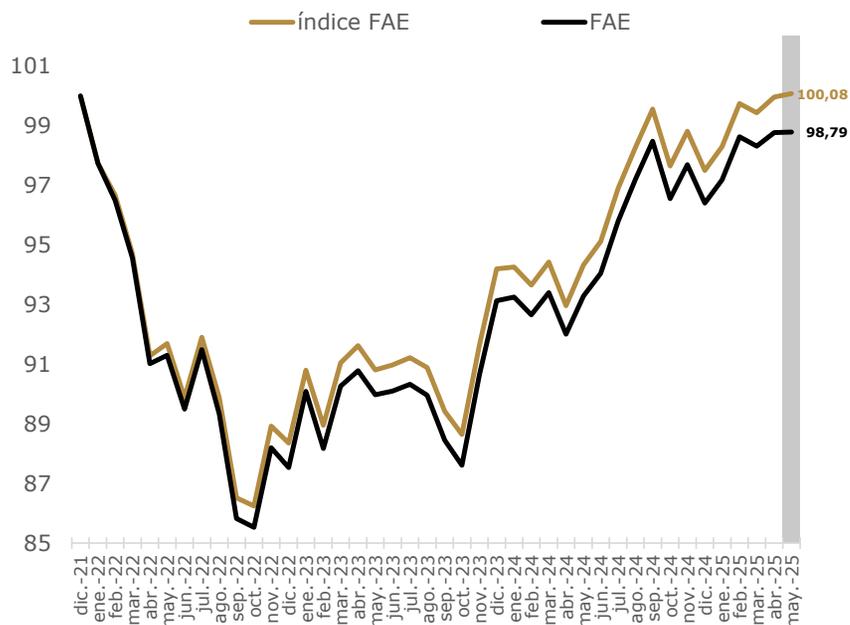


FONDO DE AHORRO Y ESTABILIZACIÓN - FAE

INFORME: MAYO 2025

Comportamiento del Fondo (Base 100 = 31 Dic 2021)



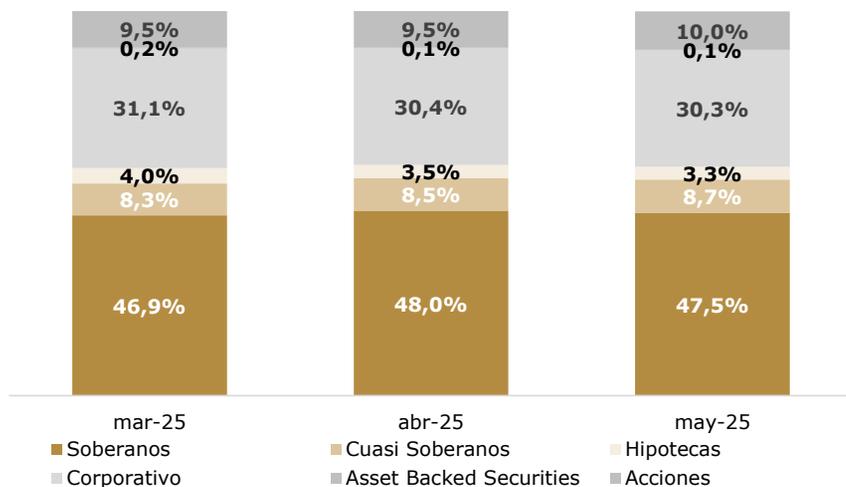
Estadísticas

	31-mar-25	30-abr-25	31-may-25	Variación
Activos Netos (USD Millones)	4.447	4.455	4.467	0,26%
Valor Unidad (USD \$)	1.197	1.199	1.199	0,01%
Activos Portafolio (USD Millones)	1.719	1.727	1.738	0,66%
Volatilidad Mensual	1,28%	0,56%	0,32%	-42,59%
Volatilidad 12 meses	1,34%	1,20%	1,18%	-1,45%
Treynor Ratio	0,03	0,12	0,10	-14,26%
Sharpe Ratio	0,58	2,47	1,35	-45,48%
Beta	0,24	0,24	0,15	-37,34%
Duración	4,59	4,58	4,23	-7,64%
Vencimiento Medio	7,20	7,01	6,58	-6,13%

Rentabilidad*

	31-mar-25	30-abr-25	31-may-25	Variación
Mensual	-0,32%	0,47%	0,02%	-96,45%
12 Meses	5,26%	7,36%	5,89%	-19,87%
2 Años Anualizada	4,36%	4,31%	4,78%	10,98%
3 Años Anualizada	1,30%	2,76%	2,66%	-3,68%

Composición*



TOP 10 Mayores Posiciones %**

MONEY MARKET FUND	6,59%
USA TREASURY 4,625% 15/10/2026	2,19%
USA TREASURY 1,125% 29/02/2028	1,43%
USA TREASURY 2,375% 31/03/2029	1,29%
USA TREASURY 2,375% 15/05/2027	1,24%
USA TREASURY 0,625% 31/03/2027	1,24%
USA TREASURY 2,25% 15/02/2027	1,23%
USA TREASURY 2,75% 30-Apr-27	1,16%
USA TREASURY 0% 19-Aug-25	1,15%
USA TREASURY 3,75% 30/06/1930	1,11%

TOTAL

18,63%

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.