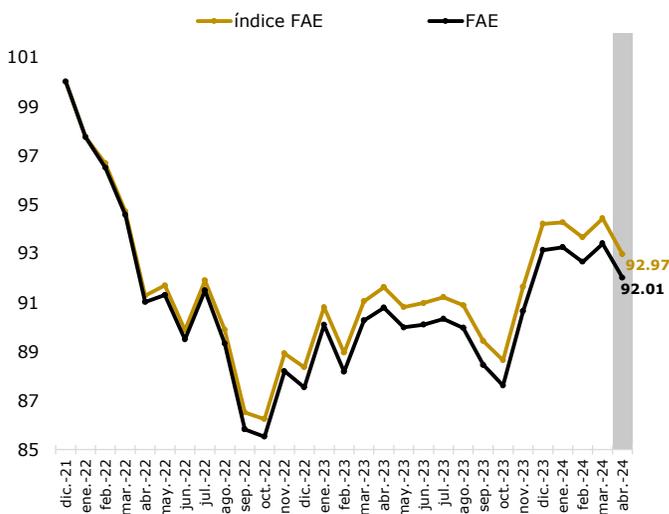


## FONDO DE AHORRO Y ESTABILIZACIÓN - FAE

### INFORME: ABRIL 2024

#### Comportamiento del Fondo (Base 100 = 31 Dic 2021)



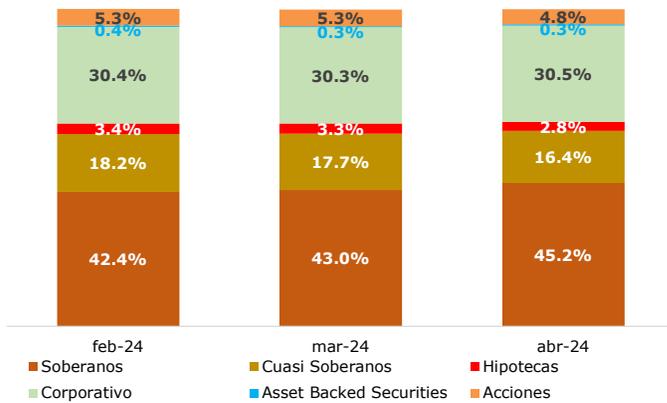
#### Estadísticas

|                                   | 29-feb-24 | 31-mar-24 | 30-abr-24 | Variación |
|-----------------------------------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| Activos Netos (USD Millones)      | 4,275     | 4,301     | 4,277     | -0.55%    |
| Valor Unidad (USD \$)             | 1,171     | 1,174     | 1,168     | -0.55%    |
| Activos Portafolio (USD Millones) | 1,547     | 1,572     | 1,549     | -1.49%    |
| Volatilidad Mensual               | 0.54%     | 1.02%     | 1.62%     | 59.81%    |
| Volatilidad 12 meses              | 1.61%     | 1.50%     | 1.58%     | 5.47%     |
| Treynor Ratio                     | 0.00      | -0.05     | -0.13     | -144.96%  |
| Sharpe Ratio                      | 0.02      | -1.08     | -2.40     | -122.37%  |
| Beta                              | 0.32      | 0.30      | 0.28      | -4.26%    |
| Duración                          | 3.86      | 3.83      | 4.06      | 6.01%     |
| Vencimiento Medio                 | 5.65      | 5.64      | 6.07      | 7.62%     |

#### Rentabilidad\*

|                   | 29-feb-24 | 31-mar-24 | 30-abr-24 | Variación |
|-------------------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| Mensual           | -0.63%    | 0.80%     | -1.49%    | -286.10%  |
| 12 Meses          | 5.09%     | 3.48%     | 1.35%     | -61.22%   |
| 2 Años Anualizada | -2.01%    | -0.62%    | 0.54%     | 187.90%   |
| 3 Años Anualizada | -1.75%    | -1.40%    | -2.20%    | -57.06%   |

#### Composición\*



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

|                                |        |
|--------------------------------|--------|
| MONEY MARKET FUND              | 15.27% |
| USA TREASURY 4.625% 30/06/2025 | 5.16%  |
| USA TREASURY 1.875% 30/06/2026 | 3.62%  |
| USA TREASURY 4.625% 15/10/2026 | 2.28%  |
| USA TREASURY 4% 15/02/2026     | 2.02%  |
| USA TREASURY 4.25% 15/10/2025  | 1.60%  |
| USA TREASURY 0.5% 30/04/2027   | 1.44%  |
| USA TREASURY 2.375% 30/04/2026 | 1.26%  |
| USA TREASURY 4.125% 15/06/2026 | 1.19%  |
| USA TREASURY 2.25% 15/02/2027  | 1.13%  |

#### TOTAL

**34.98%**

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.