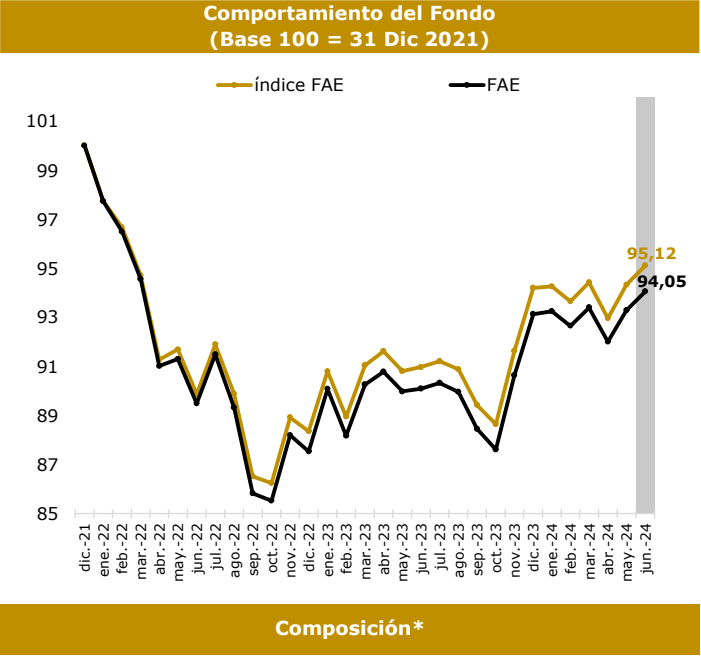
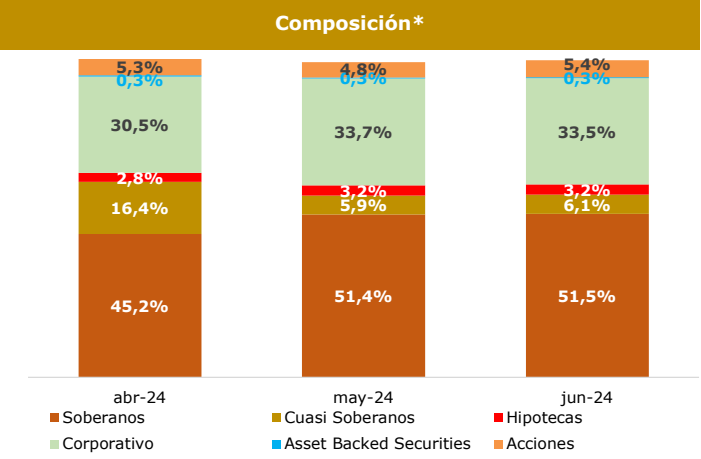


FONDO DE AHORRO Y ESTABILIZACIÓN - FAE

INFORME: JUNIO 2024



Estadísticas	30-abr-24	31-may-24	30-jun-24	Variación
Activos Netos (USD Millones)	4.277	4.299	4.312	0,30%
Valor Unidad (USD \$)	1.168	1.174	1.177	0,30%
Activos Portafolio (USD Millones)	1.549	1.570	1.583	0,82%
Volatilidad Mensual	1,62%	2,04%	0,41%	-79,93%
Volatilidad 12 meses	1,58%	1,58%	1,59%	0,33%
Treynor Ratio	-0,13	-0,05	-0,03	47,84%
Sharpe Ratio	-2,40	-0,93	-0,48	48,85%
Beta	0,28	0,29	0,29	-1,62%
Duración	4,06	4,31	4,29	-0,46%
Vencimiento Medio	6,07	6,45	6,57	1,86%
Rentabilidad*	30-abr-24	31-may-24	30-jun-24	Variación
Mensual	-1,49%	1,40%	0,82%	-41,51%
12 Meses	1,35%	3,68%	4,39%	19,34%
2 Años Anualizada	0,54%	1,08%	2,51%	131,82%
3 Años Anualizada	-2,20%	-1,90%	-1,93%	-1,20%



Fuente: Banrep, Bloomberg, Cálculos Grupo Financiero Asesor

TOP 10 Mayores Posiciones %**	
USA TREASURY 1,875% 30/06/2026	3,60%
MONEY MARKET FUND	2,94%
USA TREASURY 4,25% 15/10/2025	2,79%
USA TREASURY 4,625% 15/10/2026	2,27%
USA TREASURY 4% 15/02/2026	2,01%
USA TREASURY 6,875% 15/08/2025	1,77%
USA TREASURY 0,5% 30/04/2027	1,43%
USA TREASURY 2,375% 15/05/2027	1,34%
USA TREASURY 2,375% 30/04/2026	1,25%
USA TREASURY 2,75% 30/04/2027	1,18%
TOTAL	20,59%

*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.