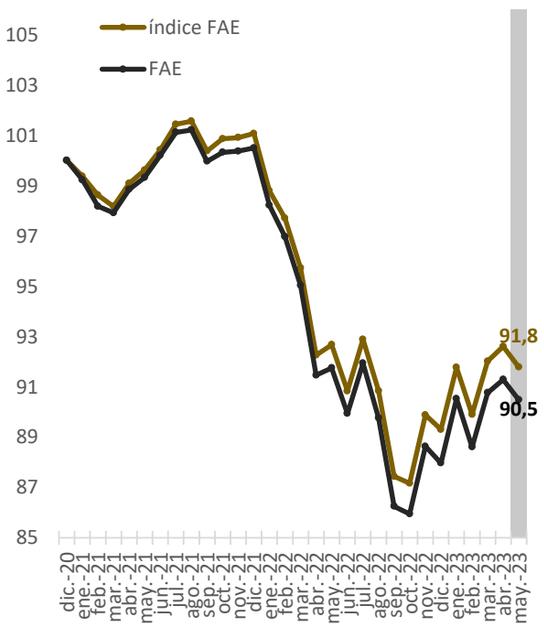
FONDO DE AHORRO Y ESTABILIZACIÓN - FAE

INFORME: MAYO 2023

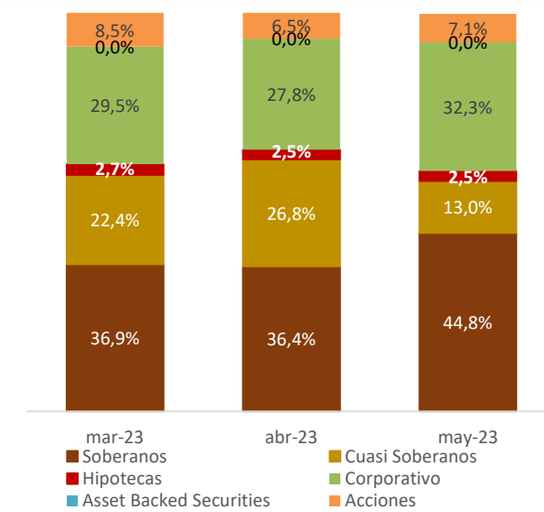
Comportamiento del Fondo (Base 100 = 31 Dic 2020)



Estadísticas	31-mar-23	30-abr-23	31-may-23	Variación
Activos Netos (USD Millones)	3.678,9	3.694,5	3.695,8	0,03%
Valor Unidad (USD $)	1.160,3	1.161,9	1.159,2	-0,23%
Volatilidad Mensual	3,22%	1,32%	1,03%	-21,48%
Volatilidad 12 meses	2,56%	2,33%	2,34%	0,49%
Sharpe Ratio	-3,11	-1,69	-2,31	-36,74%
Beta	0,30	0,32	0,30	-5,11%
Duración	4,12	4,52	4,45	-1,55%
Vencimiento Medio	6,05	6,51	6,47	-0,61%

Rentabilidad*	31-mar-23	30-abr-23	31-may-23	Variación
Mensual	2,44%	0,58%	-0,88%	-253,67%
12 Meses	-4,49%	-0,19%	-1,38%	-621,04%
2 Años Anualizada	-3,72%	-3,90%	-4,55%	-16,82%
3 Años Anualizada	-0,44%	-1,23%	-1,88%	-53,44%

Composición*



Fuente: Banrep, Bloomberg, Cálculos Grupo Financiero Asesor

TOP 10 Mayores Posiciones %**

MONEY MARKET FUND	9,58%
STATE STREET CORP	6,29%
USA TREASURY 0,375% 30/04/2025	3,70%
USA TREASURY 0,25% 15/06/2024	2,15%
USA TREASURY 2,375% 30/04/2026	2,07%
USA TREASURY 2,125% 30/11/2024	1,49%
USA TREASURY 2,875% 31/05/2025	1,35%
FEDERAL NATIONAL MORTGAGE 2% 01/03/2052	1,34%
USA TREASURY 3,875% 31/03/2025	1,33%
USA TREASURY 2,875% 30/04/2025	1,22%
TOTAL	**30,52%**

*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.