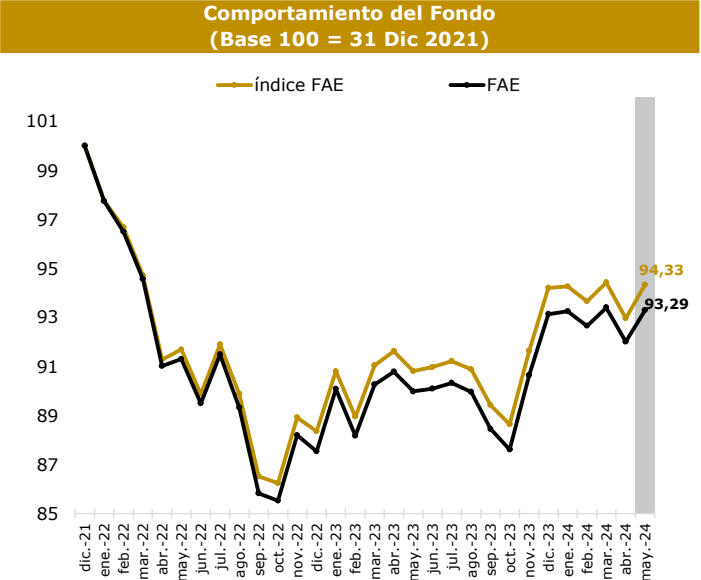
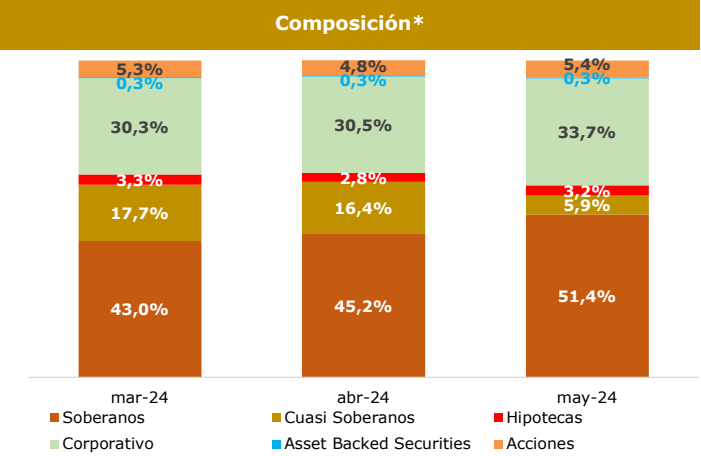


FONDO DE AHORRO Y ESTABILIZACIÓN - FAE

INFORME: MAYO 2024



| Estadísticas                      | 31-mar-24 | 30-abr-24 | 31-may-24 | Variación |
|-----------------------------------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| Activos Netos (USD Millones)      | 4.301     | 4.277     | 4.299     | 0,51%     |
| Valor Unidad (USD \$)             | 1.174     | 1.168     | 1.174     | 0,51%     |
| Activos Portafolio (USD Millones) | 1.572     | 1.549     | 1.570     | 1,40%     |
| Volatilidad Mensual               | 1,02%     | 1,62%     | 2,04%     | 25,92%    |
| Volatilidad 12 meses              | 1,50%     | 1,58%     | 1,58%     | 0,32%     |
| Treynor Ratio                     | -0,06     | -0,13     | -0,05     | 61,75%    |
| Sharpe Ratio                      | -1,08     | -2,40     | -0,93     | 61,12%    |
| Beta                              | 0,30      | 0,28      | 0,29      | 1,97%     |
| Duración                          | 3,83      | 4,06      | 4,31      | 6,16%     |
| Vencimiento Medio                 | 5,64      | 6,07      | 6,45      | 6,26%     |
| Rentabilidad*                     | 31-mar-24 | 30-abr-24 | 31-may-24 | Variación |
| Mensual                           | 0,80%     | -1,49%    | 1,40%     | 193,58%   |
| 12 Meses                          | 3,48%     | 1,35%     | 3,68%     | 173,03%   |
| 2 Años Anualizada                 | -0,62%    | 0,54%     | 1,08%     | 99,70%    |
| 3 Años Anualizada                 | -1,40%    | -2,20%    | -1,90%    | 13,46%    |



Fuente: Banrep, Bloomberg, Cálculos Grupo Financiero Asesor

| TOP 10 Mayores Posiciones %**  |        |
|--------------------------------|--------|
| USA TREASURY 1,875% 30/06/2026 | 3,60%  |
| USA TREASURY 4,25% 15/10/2025  | 2,80%  |
| USA TREASURY 4,625% 30/06/2025 | 2,73%  |
| MONEY MARKET FUND              | 2,52%  |
| USA TREASURY 4,625% 15/10/2026 | 2,27%  |
| USA TREASURY 4% 15/02/2026     | 2,01%  |
| 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 4,125% 15/06/2026 | 1,18%  |
| TOTAL                          | 21,13% |

\*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.