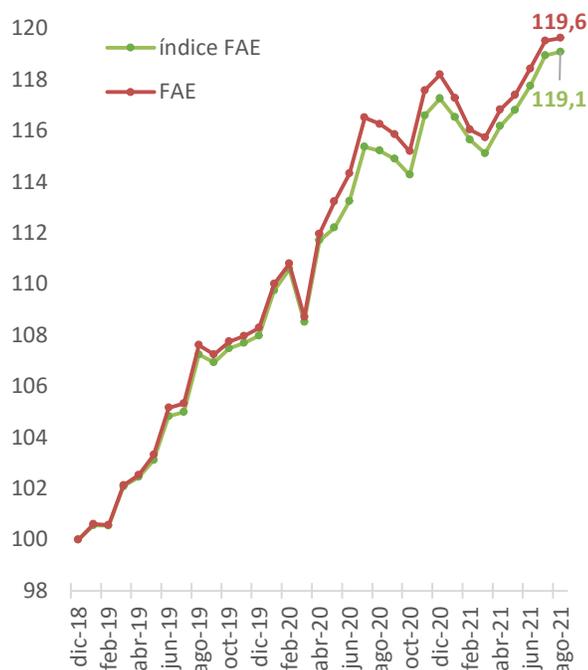


FONDO DE AHORRO Y ESTABILIZACIÓN - FAE

INFORME: AGOSTO 2021

Comportamiento del Fondo (Base 100 = 31 Dic 2018)



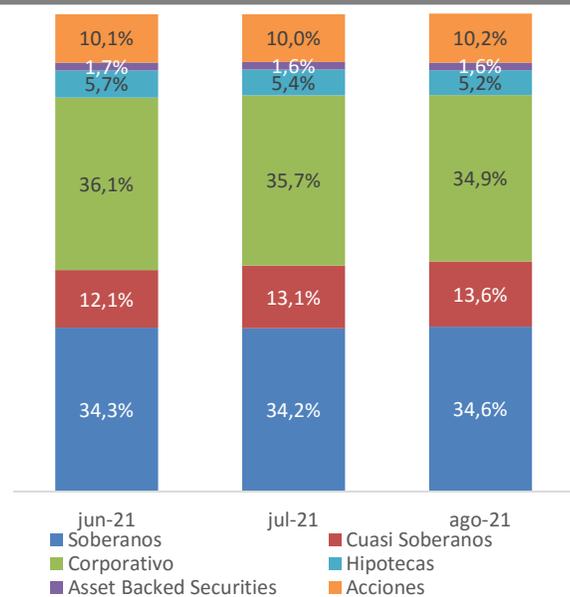
Estadísticas

Estadísticas	30-jun-21	31-jul-21	31-ago-21	Variación
Activos Netos (USD Millones)	3660,7	3669,2	3676,1	0,2%
Valor Unidad (USD \$)	1183,0	1185,1	1185,3	0,0%
Volatilidad Mensual	0,29%	0,02%	0,58%	2769,7%
Volatilidad 12 meses	1,02%	0,91%	0,90%	-1,0%
Sharpe Ratio	3,46	2,76	3,14	13,9%
Beta	0,15	0,15	0,14	-12,0%
Duración	5,33	5,42	5,41	-0,2%
Vencimiento Medio	7,78	7,87	7,83	-0,5%

Rentabilidad*

Rentabilidad*	30-jun-21	31-jul-21	31-ago-21	Variación
Mensual	0,89%	0,92%	0,09%	-90,0%
12 Meses	3,60%	2,58%	2,89%	12,2%
2 Años Anualizada	6,12%	6,52%	5,44%	-16,7%
3 Años Anualizada	6,42%	6,80%	6,66%	-2,1%

Composición*



Fuente: Banrep, Bloomberg, Cálculos Grupo Financiero Asesor

TOP 10 Mayores Posiciones %**

MONEY MARKET FUND	6,14%
STATE STREET CORP	4,85%
USA TREASURY 2,125% 31/12/2022	2,70%
USA TREASURY 0,25% 15/04/2023	2,66%
USA TREASURY 0,375% 15/04/2024	2,33%
USA TREASURY 0,25% 15/06/2023	1,59%
USA TREASURY 2,25% 31/12/2023	1,53%
USA TREASURY 2,875% 31/05/2025	1,36%
USA TREASURY 1,375% 15/10/2022	1,30%
USA TREASURY 3,125% 15/08/2044	1,26%
TOTAL	25,72%

*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.