

FONDO DE AHORRO Y ESTABILIZACIÓN - FAE

INFORME: AGOSTO 2022

Comportamiento del Fondo (Base 100 = 31 Dic 2019)



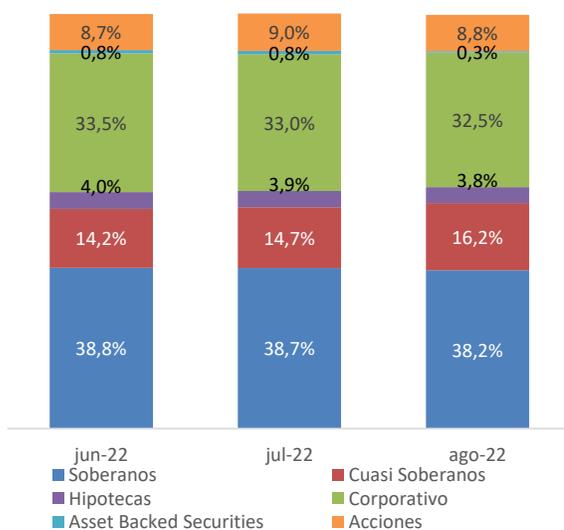
Estadísticas

Estadísticas	30-jun-22	31-jul-22	31-ago-22	Variación
Activos Netos (USD Millones)	3.646,6	3.668,9	3.655,6	-0,4%
Valor Unidad (USD \$)	1.158,2	1.163,2	1.157,8	-0,5%
Volatilidad Mensual	1,62%	2,97%	3,24%	9,3%
Volatilidad 12 meses	1,41%	1,60%	1,64%	2,2%
Sharpe Ratio	-7,52	-5,98	-7,34	-22,7%
Beta	0,22	0,23	0,23	-0,2%
Duración	4,75	4,76	4,56	-4,2%
Vencimiento Medio	7,06	7,10	6,87	-3,2%

Rentabilidad*

Rentabilidad*	30-jun-22	31-jul-22	31-ago-22	Variación
Mensual	-1,97%	2,22%	-2,37%	-206,4%
12 Meses	-10,24%	-9,08%	-11,31%	-24,6%
2 Años Anualizada	-3,57%	-3,43%	-4,47%	-30,5%
3 Años Anualizada	0,36%	1,05%	-0,47%	-145,0%

Composición*



TOP 10 Mayores Posiciones %**

MONEY MARKET FUND	10,86%
USA TREASURY 0,75% 31/12/2023	2,61%
USA TREASURY 2,125% 30/11/2024	2,09%
USA TREASURY 2,875% 30/04/2025	1,73%
USA TREASURY 0,25% 15/06/2024	1,72%
USA TREASURY 1,875% 31/08/2024	1,60%
USA TREASURY 0,75% 31/08/2026	1,53%
USA TREASURY 0,25% 31/07/2025	1,50%
USA TREASURY 2,875% 31/05/2025	1,25%
USA TREASURY 1,125% 31/08/2028	1,24%
TOTAL	26,13%

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.