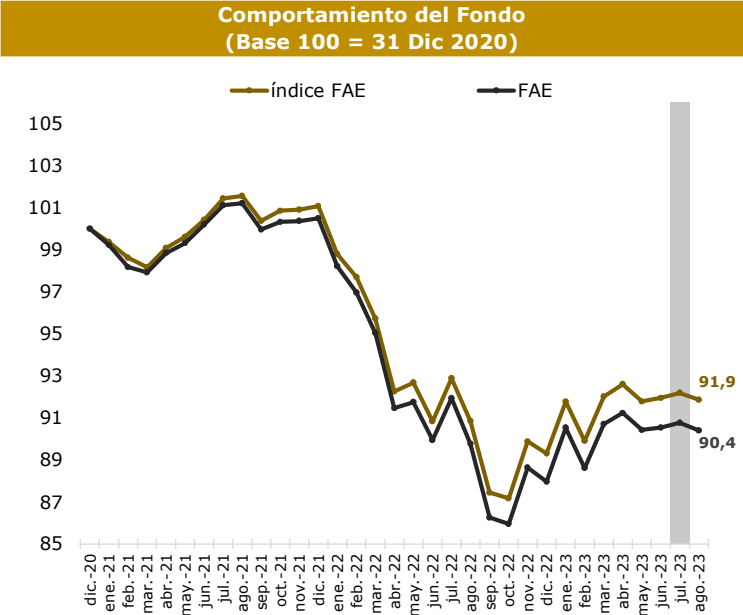


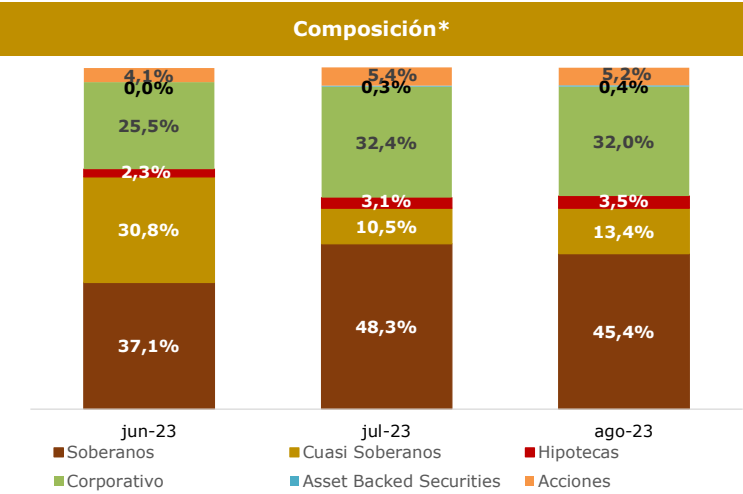
FONDO DE AHORRO Y ESTABILIZACIÓN - FAE

INFORME: AGOSTO 2023



Estadísticas	30-jun-23	31-jul-23	31-ago-23	Variación
Activos Netos (USD Millones)	4.114,1	4.126,0	4.129,9	0,10%
Valor Unidad (USD \$)	1.159,6	1.160,6	1.159,1	-0,14%
Volatilidad Mensual	0,72%	0,09%	0,46%	430,55%
Volatilidad 12 meses	2,26%	2,16%	2,04%	-5,45%
Treynor Ratio	-0,13	-0,19	-0,13	30,54%
Sharpe Ratio	-1,61	-2,69	-1,97	26,87%
Beta	0,28	0,30	0,30	-0,45%
Duración	4,52	4,42	4,22	-4,52%
Vencimiento Medio	6,50	6,44	6,20	-3,73%

Rentabilidad*	30-jun-23	31-jul-23	31-ago-23	Variación
Mensual	0,13%	0,25%	-0,40%	-259,05%
12 Meses	0,67%	-1,27%	0,71%	156,02%
2 Años Anualizada	-4,94%	-5,26%	-5,49%	-4,46%
3 Años Anualizada	-2,18%	-2,71%	-2,77%	-2,26%



Fuente: Banrep, Bloomberg, Cálculos Grupo Financiero Asesor

TOP 10 Mayores Posiciones %**	
MONEY MARKET FUND	9,33%
USA TREASURY 4,625% 30/06/2025	5,66%
USA TREASURY 0,375% 30/04/2025	2,51%
USA TREASURY 4,25% 30/09/2024	2,42%
USA TREASURY 1,875% 30/06/2026	2,40%
USA TREASURY 2,375% 30/04/2026	1,40%
USA TREASURY 4,125% 15/06/2026	1,31%
USA TREASURY 3,5% 15/02/2033	1,24%
USA TREASURY 0% 19/10/2023	1,08%
USA TREASURY 0,75% 31/03/2026	1,02%
TOTAL	28,38%

*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.