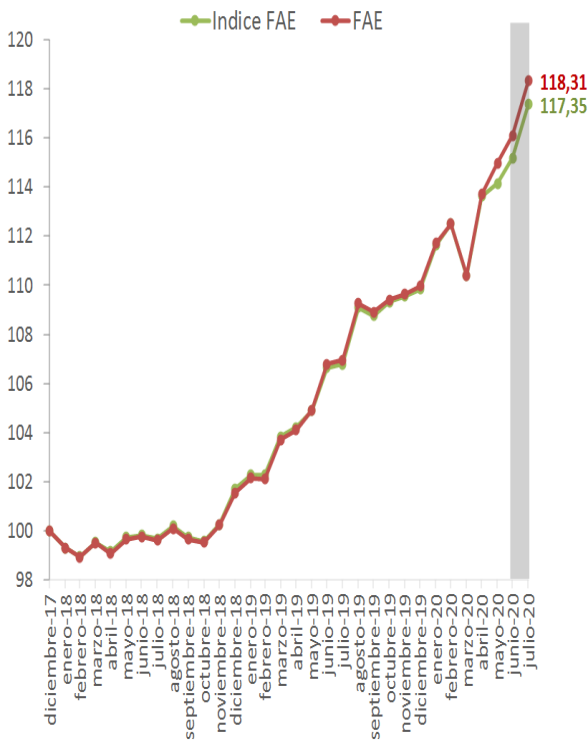


# FONDO DE AHORRO Y ESTABILIZACIÓN - FAE

INFORME: JULIO 2020

## Comportamiento del Fondo (Base 100 = 31 Dic 2017)

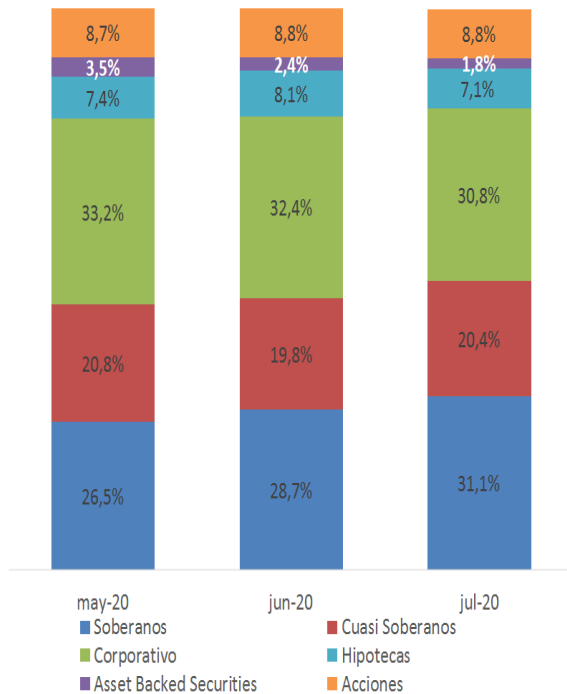


| Estadísticas                 | 31-may-20 | 30-jun-20 | 31-jul-20 | Variación |
|------------------------------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| Activos Netos (USD Millones) | 3.837,8   | 3.861,8   | 3.894,3   | 0,8%      |
| Valor Unidad (USD \$)        | 1.170,9   | 1.173,5   | 1.178,9   | 0,5%      |
| Volatilidad Mensual          | 1,33%     | 0,10%     | 0,67%     | 549,4%    |
| Volatilidad 12 meses         | 1,22%     | 1,22%     | 1,23%     | 0,8%      |
| Sharpe Ratio                 | 7,06      | 6,49      | 8,11      | 25,1%     |
| Beta                         | 0,12      | 0,13      | 0,13      | 1,8%      |
| Duración                     | 5,30      | 5,19      | 5,26      | 1,3%      |
| Vencimiento Medio            | 7,74      | 7,62      | 7,67      | 0,7%      |

| Rentabilidad*     | 31-may-20 | 30-jun-20 | 31-jul-20 | Variación |
|-------------------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| Mensual           | 1,12%     | 0,97%     | 1,92%     | 97,3%     |
| 12 Meses          | 9,59%     | 8,71%     | 10,62%    | 21,9%     |
| 2 Años Anualizada | 7,41%     | 7,87%     | 8,98%     | 14,1%     |
| 3 Años Anualizada | 4,93%     | 5,26%     | 5,88%     | 11,6%     |

\*Las estadísticas solo reflejan el comportamiento de los activos bajo administración, no incluye los pagarés de la Nación.

## Composición\*



\*Las estadísticas solo reflejan el comportamiento de los activos bajo administración, no incluye los pagarés de la Nación.

Fuente: Banrep, Bloomberg, Cálculos Grupo Financiero Asesor

## TOP 10 Mayores Posiciones %\*\*

|                                                     |        |
|-----------------------------------------------------|--------|
| MONEY MARKET FUND                                   | 26,92% |
| REPUBLIC OF COLOMBIA BOND FIXED 4,375% 12/07/2021   | 18,89% |
| STATE STREET CORP                                   | 2,56%  |
| G.N.M.A. (GOVERNMENT NAT. MORTGAGE ASSOC)           | 1,81%  |
| UNITED STATES OF AMERICA TREASURY 0,25% 15/06/2023  | 1,72%  |
| UNITED STATES OF AMERICA TREASURY 3,125% 15/08/2044 | 1,58%  |
| OESTERREICHISCHE KONTROLLBANK VIENNA                | 1,34%  |
| UNITED STATES OF AMERICA TREASURY 2,125% 15/05/2025 | 1,30%  |
| UNITED STATES OF AMERICA TREASURY 2,125% 15/05/2022 | 1,11%  |
| UNITED STATES OF AMERICA TREASURY 2,75% 30/06/2025  | 1,05%  |

\*\*Incluye los activos de renta fija que hacen parte de los activos bajo administración.

**TOTAL**

**58,28%**