

FONDO DE AHORRO Y ESTABILIZACIÓN - FAE

INFORME: JULIO 2021

Comportamiento del Fondo (Base 100 = 31 Dic 2018)



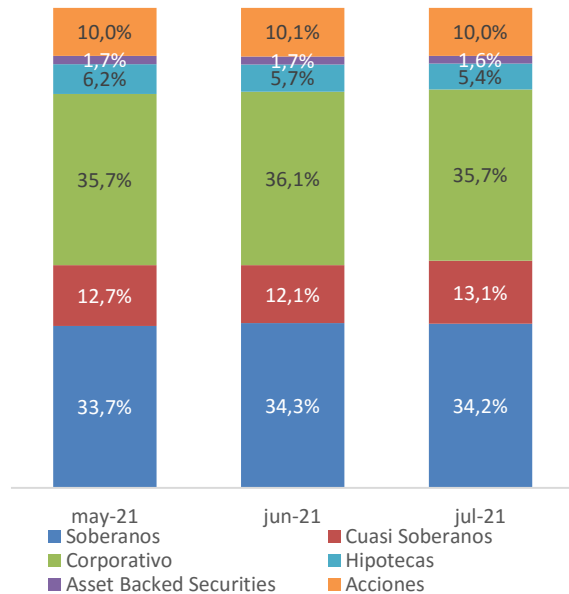
Estadísticas

	31-may-21	30-jun-21	31-jul-21	Variación
Activos Netos (USD Millones)	3650,8	3660,7	3669,2	0,2%
Valor Unidad (USD \$)	1181,0	1183,0	1185,1	0,2%
Volatilidad Mensual	0,33%	0,29%	0,02%	-92,9%
Volatilidad 12 meses	1,02%	1,02%	0,91%	-10,8%
Sharpe Ratio	3,52	3,46	2,76	-20,2%
Beta	0,16	0,15	0,15	1,3%
Duración	5,26	5,33	5,42	1,7%
Vencimiento Medio	7,69	7,78	7,87	1,2%

Rentabilidad*

	31-may-21	30-jun-21	31-jul-21	Variación
Mensual	0,48%	0,89%	0,92%	3,2%
12 Meses	3,68%	3,60%	2,58%	-28,3%
2 Años Anualizada	6,59%	6,12%	6,52%	6,5%
3 Años Anualizada	6,15%	6,42%	6,80%	5,9%

Composición*



Fuente: Banrep, Bloomberg, Cálculos Grupo Financiero Asesor

TOP 10 Mayores Posiciones %**

MONEY MARKET FUND	5,82%
STATE STREET CORP	4,89%
USA TREASURY 2,125% 31/12/2022	2,72%
USA TREASURY 0,25% 15/04/2023	2,68%
USA TREASURY 0,375% 15/04/2024	2,35%
USA TREASURY 1,375% 15/10/2022	1,86%
USA TREASURY 0,25% 15/06/2023	1,60%
USA TREASURY 2,25% 31/12/2023	1,55%
USA TREASURY 2,875% 31/05/2025	1,38%
USA TREASURY 3,125% 15/08/2044	1,29%
TOTAL	26,13%

*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.