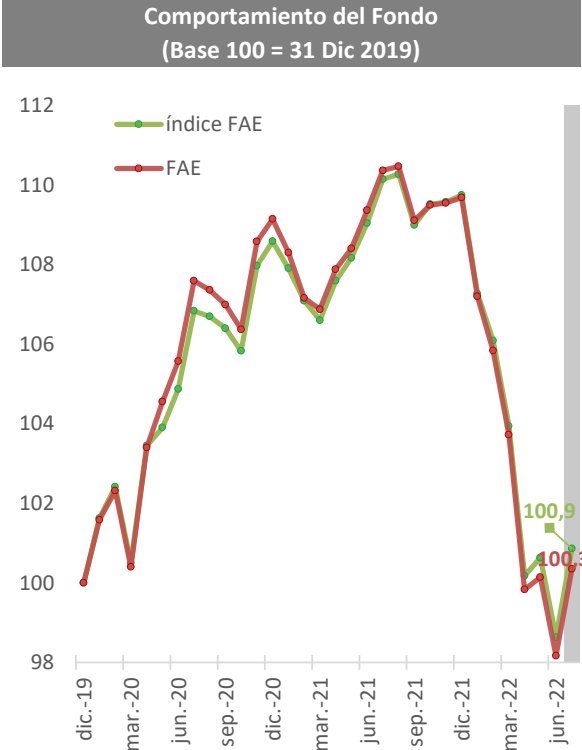


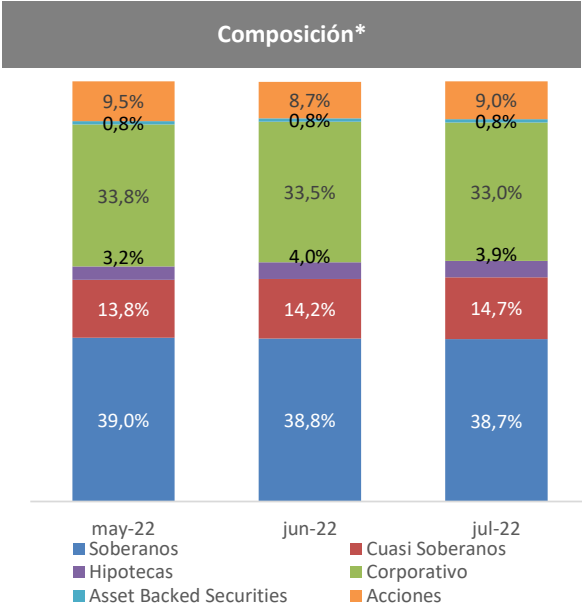
FONDO DE AHORRO Y ESTABILIZACIÓN - FAE

INFORME: JULIO 2022



Estadísticas	31-may-22	30-jun-22	31-jul-22	Variación
Activos Netos (USD Millones)	3.654,1	3.646,6	3.668,9	0,6%
Valor Unidad (USD \$)	1.162,7	1.158,2	1.163,2	0,4%
Volatilidad Mensual	2,88%	1,62%	2,97%	83,4%
Volatilidad 12 meses	1,45%	1,41%	1,60%	13,4%
Sharpe Ratio	-5,43	-7,52	-5,98	20,5%
Beta	0,23	0,22	0,23	6,7%
Duración	4,90	4,75	4,76	0,2%
Vencimiento Medio	7,23	7,06	7,10	0,6%

Rentabilidad*	31-may-22	30-jun-22	31-jul-22	Variación
Mensual	0,31%	-1,97%	2,22%	212,6%
12 Meses	-7,62%	-10,24%	-9,08%	11,4%
2 Años Anualizada	-2,13%	-3,57%	-3,43%	4,1%
3 Años Anualizada	1,63%	0,36%	1,05%	189,2%



TOP 10 Mayores Posiciones %**	
MONEY MARKET FUND	7,86%
USA TREASURY 0,75% 31/12/2023	2,57%
USA TREASURY 2,125% 30/11/2024	2,08%
USA TREASURY 2,875% 30/04/2025	1,72%
USA TREASURY 0,25% 15/06/2024	1,70%
USA TREASURY 1,875% 31/08/2024	1,60%
USA TREASURY 0,75% 31/08/2026	1,54%
USA TREASURY 0,125% 15/07/2023	1,32%
USA TREASURY 1,125% 31/08/2028	1,26%
USA TREASURY 2,875% 31/05/2025	1,24%
TOTAL	
22,89%	

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.