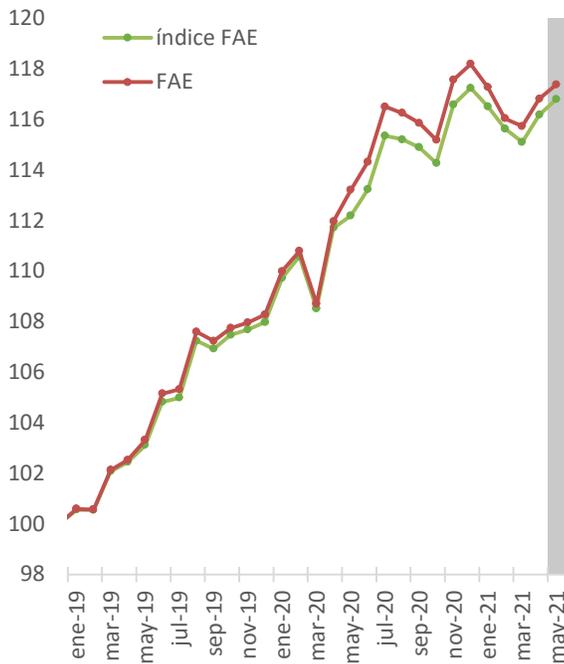


# FONDO DE AHORRO Y ESTABILIZACIÓN - FAE

## INFORME: MAYO 2021

### Comportamiento del Fondo (Base 100 = 31 Dic 2018)



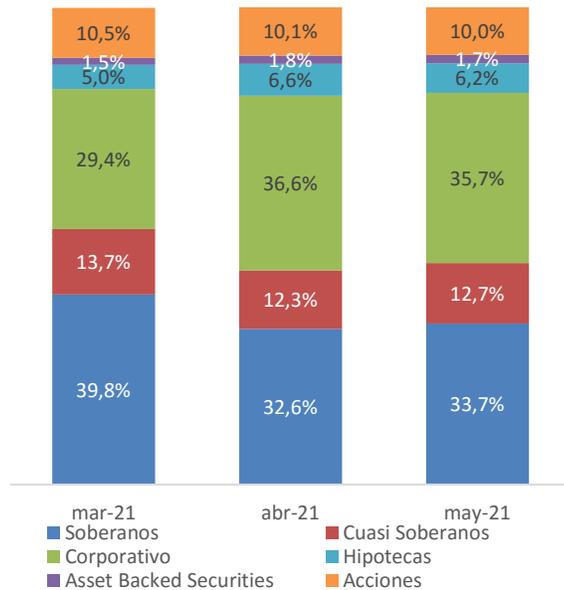
### Estadísticas

Estadísticas	31-mar-21	30-abr-21	31-may-21	Variación
Activos Netos (USD Millones)	4006,0	3643,6	3650,8	0,2%
Valor Unidad (USD \$)	1176,8	1179,9	1181,0	0,1%
Volatilidad Mensual	0,56%	0,85%	0,33%	-61,7%
Volatilidad 12 meses	1,29%	1,05%	1,02%	-2,5%
Sharpe Ratio	4,92	4,05	3,52	-13,1%
Beta	0,17	0,20	0,16	-20,4%
Duración	4,24	5,17	5,26	1,7%
Vencimiento Medio	6,31	7,58	7,69	1,5%

### Rentabilidad\*

Rentabilidad*	31-mar-21	30-abr-21	31-may-21	Variación
Mensual	-0,26%	0,94%	0,48%	-49,0%
12 Meses	6,45%	4,34%	3,68%	-15,1%
2 Años Anualizada	6,45%	6,74%	6,59%	-2,2%
3 Años Anualizada	5,70%	6,18%	6,15%	-0,5%

### Composición\*



Fuente: Banrep, Bloomberg, Cálculos Grupo Financiero Asesor

### TOP 10 Mayores Posiciones %\*\*

MONEY MARKET FUND	5,18%
STATE STREET CORP	5,03%
USA TREASURY 0,25% 15/04/2023	2,75%
USA TREASURY 0,125% 30/06/2022	2,33%
USA TREASURY 2,125% 31/12/2022	1,93%
USA TREASURY 1,375% 15/10/2022	1,91%
USA TREASURY 0,25% 15/06/2023	1,65%
USA TREASURY 2,25% 31/12/2023	1,61%
USA TREASURY 2,875% 31/05/2025	1,43%
OeKB Vienna 2,875% 13/03/2023	1,25%
<b>TOTAL</b>	<b>25,07%</b>

\*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.