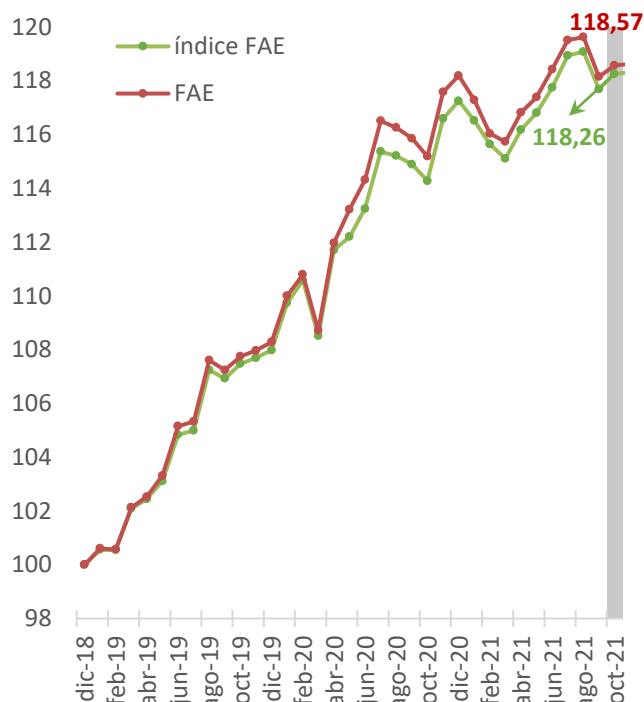


FONDO DE AHORRO Y ESTABILIZACIÓN - FAE

INFORME: OCTUBRE 2021

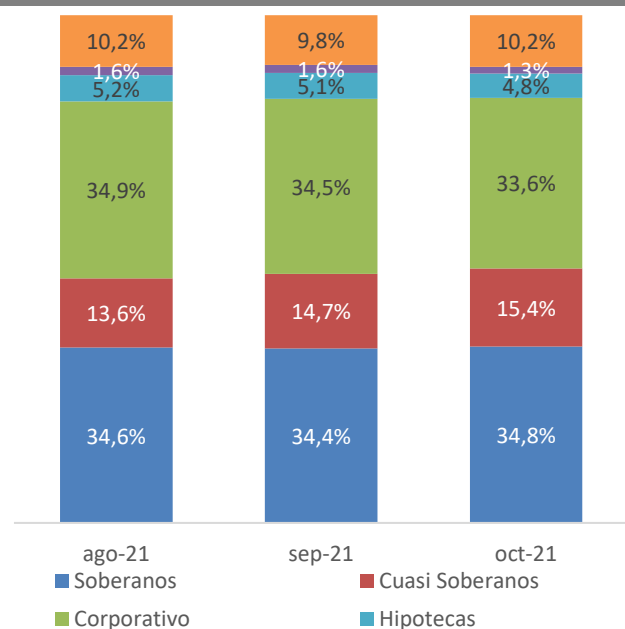
Comportamiento del Fondo (Base 100 = 31 Dic 2018)



Estadísticas	31-ago-21	30-sep-21	31-oct-21	Variación
Activos Netos (USD Millones)	3676,1	3670,4	3678,0	0,2%
Valor Unidad (USD \$)	1185,3	1182,4	1183,3	0,1%
Volatilidad Mensual	0,58%	0,93%	1,12%	19,9%
Volatilidad 12 meses	0,90%	0,98%	0,95%	-2,9%
Sharpe Ratio	3,14	1,94	3,01	54,8%
Beta	0,14	0,17	0,18	0,8%
Duración	5,41	5,30	5,28	-0,4%
Vencimiento Medio	7,83	7,63	7,64	0,1%

Rentabilidad*	31-ago-21	30-sep-21	31-oct-21	Variación
Mensual	0,09%	-1,23%	0,35%	128,9%
12 Meses	2,89%	1,98%	2,94%	48,6%
2 Años Anualizada	5,44%	4,96%	4,90%	-1,2%
3 Años Anualizada	6,66%	6,38%	6,55%	2,7%

Composición*



Fuente: Banrep, Bloomberg, Cálculos Grupo Financiero Asesor

TOP 10 Mayores Posiciones %**

USA TREASURY 0,25% 15/04/2023	2,98%
USA TREASURY 0,375% 15/04/2024	2,30%
USA TREASURY 2,125% 31/12/2022	1,99%
USA TREASURY 1,875% 31/08/2024	1,68%
USA TREASURY 0,25% 15/06/2023	1,58%
USA TREASURY 2,25% 31/12/2023	1,52%
USA TREASURY 1,125% 31/08/2028	1,36%
USA TREASURY 2,875% 31/05/2025	1,34%
USA TREASURY 0,125% 15/10/2025	1,24%
USA TREASURY 3,125% 15/08/2044	1,23%
TOTAL	17,23%

*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.