

# FONDO DE AHORRO Y ESTABILIZACIÓN - FAE

## INFORME: OCTUBRE 2022

### Comportamiento del Fondo (Base 100 = 31 Dic 2019)



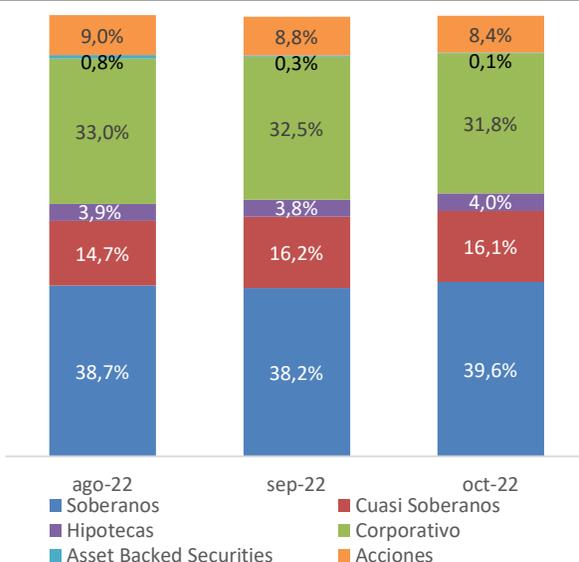
### Estadísticas

Estadísticas	31-ago-22	30-sep-22	31-oct-22	Variación
Activos Netos (USD Millones)	3.655,6	3.627,8	3.625,4	-0,1%
Valor Unidad (USD \$)	1.157,8	1.148,9	1.148,2	-0,1%
Volatilidad Mensual	3,24%	1,10%	2,52%	130,1%
Volatilidad 12 meses	1,64%	1,84%	1,80%	-2,4%
Sharpe Ratio	-7,35	-7,98	-9,01	-12,9%
Beta	0,23	0,25	0,23	-7,7%
Duración	4,56	4,35	4,31	-0,9%
Vencimiento Medio	6,87	6,62	6,50	-1,8%

### Rentabilidad\*

Rentabilidad*	31-ago-22	30-sep-22	31-oct-22	Variación
Mensual	-2,37%	-3,92%	-0,35%	91,1%
12 Meses	-11,31%	-13,72%	-14,33%	-4,4%
2 Años Anualizada	-4,47%	-6,20%	-6,09%	1,8%
3 Años Anualizada	-0,47%	-1,68%	-1,94%	-16,0%

### Composición\*



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

MONEY MARKET FUND	10,53%
USA TREASURY 0,75% 31/12/2023	2,70%
USA TREASURY 2,125% 30/11/2024	2,15%
USA TREASURY 2,875% 31/05/2025	1,96%
USA TREASURY 0,25% 15/06/2024	1,78%
USA TREASURY 2,875% 30/04/2025	1,75%
USA TREASURY 1,875% 31/08/2024	1,65%
USA TREASURY 0,75% 31/08/2026	1,55%
USA TREASURY 0,25% 31/07/2025	1,53%
USA TREASURY 0,375% 15/04/2024	1,25%
<b>TOTAL</b>	<b>26,86%</b>

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.