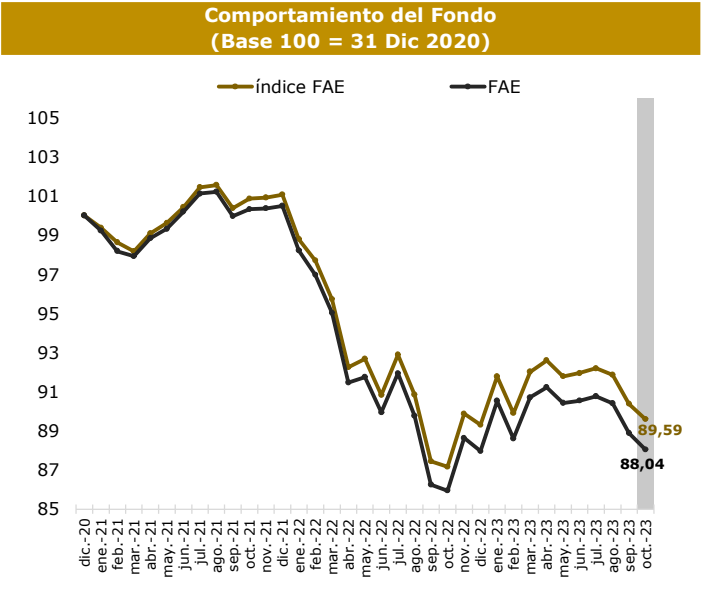


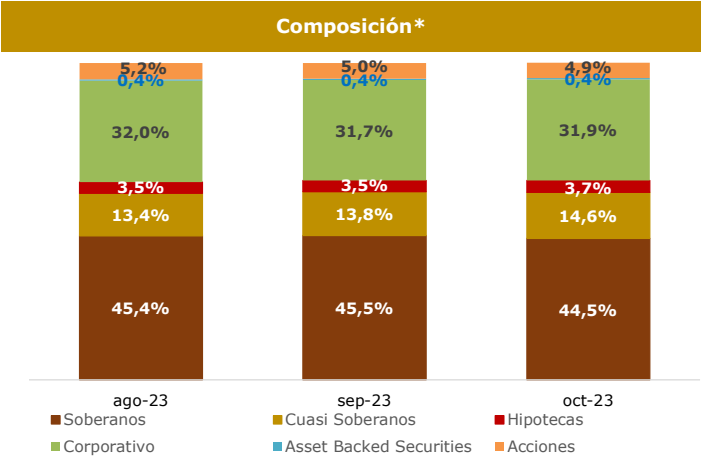
FONDO DE AHORRO Y ESTABILIZACIÓN - FAE

INFORME: OCTUBRE 2023



Estadísticas	31-ago-23	30-sep-23	31-oct-23	Variación
Activos Netos (USD Millones)	4.129,9	4.111,1	4.105,9	-0,13%
Valor Unidad (USD \$)	1.159,1	1.152,5	1.148,8	-0,32%
Activos Portafolio (USD Millones)	1.401,5	1.382,7	1.377,9	-0,35%
Volatilidad Mensual	0,46%	0,90%	0,51%	-43,04%
Volatilidad 12 meses	2,04%	1,72%	1,74%	1,64%
Treynor Ratio	-0,14	-0,06	-0,10	-63,27%
Sharpe Ratio	-1,97	-1,05	-1,45	-37,48%
Beta	0,30	0,29	0,24	-14,41%
Duración	4,22	4,09	3,94	-3,67%
Vencimiento Medio	6,20	6,00	5,84	-2,67%

Rentabilidad*	31-ago-23	30-sep-23	31-oct-23	Variación
Mensual	-0,40%	-1,68%	-0,95%	43,25%
12 Meses	0,71%	3,06%	2,44%	-20,37%
2 Años Anualizada	-5,49%	-5,70%	-6,32%	-10,79%
3 Años Anualizada	-2,77%	-3,21%	-3,33%	-3,74%



Fuente: Banrep, Bloomberg, Cálculos Grupo Financiero Asesor

TOP 10 Mayores Posiciones %**	
MONEY MARKET FUND	10,50%
USA TREASURY 4,625% 30/06/2025	5,80%
USA TREASURY 1,875% 30/06/2026	3,50%
USA TREASURY 0,375% 30/04/2025	2,60%
USA TREASURY 0% 18/04/2024	1,50%
USA TREASURY 2,375% 30/04/2026	1,40%
USA TREASURY 4,125% 15/06/2026	1,30%
USA TREASURY 3,5% 15/02/2033	1,20%
USA TREASURY 2,5% 31/01/2025	1,20%
USA TREASURY 0,75% 31/03/2026	1,00%
TOTAL	30,00%

*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.