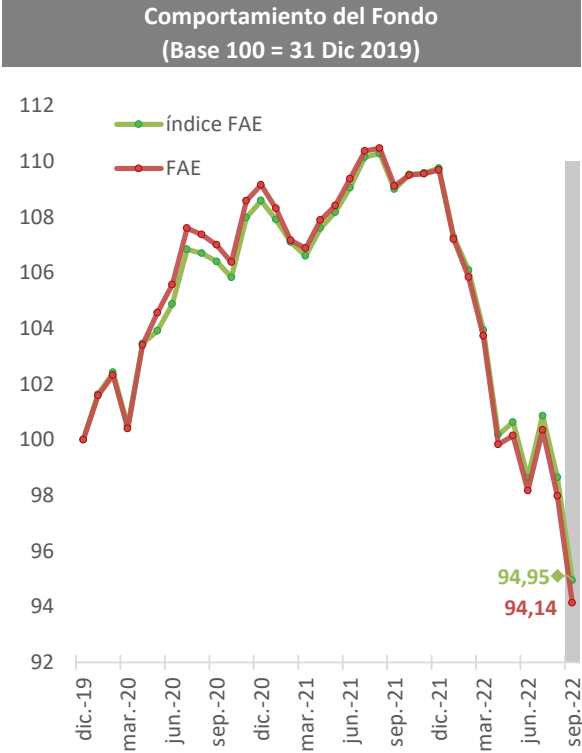


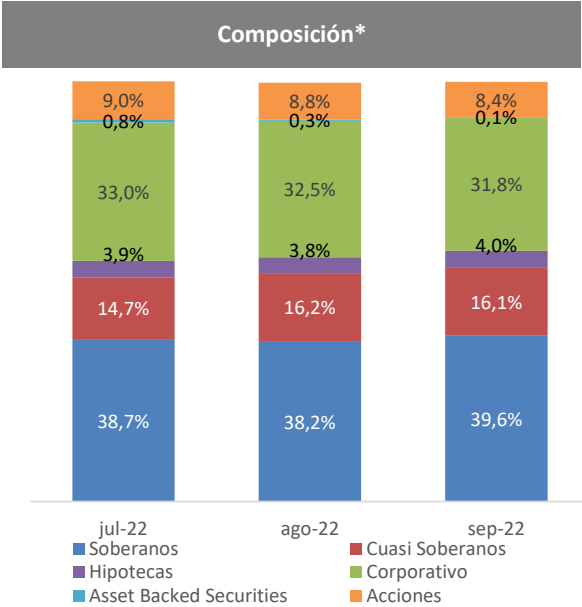
FONDO DE AHORRO Y ESTABILIZACIÓN - FAE

INFORME: AGOSTO 2022



Estadísticas	31-jul-22	31-ago-22	30-sep-22	Variación
Activos Netos (USD Millones)	3.668,9	3.655,6	3.627,8	-0,8%
Valor Unidad (USD \$)	1.163,2	1.157,8	1.148,9	-0,8%
Volatilidad Mensual	2,97%	3,24%	1,10%	-66,2%
Volatilidad 12 meses	1,60%	1,64%	1,84%	12,7%
Sharpe Ratio	-5,98	-7,33	-7,96	-8,6%
Beta	0,23	0,23	0,25	7,0%
Duración	4,76	4,56	4,35	-4,6%
Vencimiento Medio	7,10	6,87	6,62	-3,6%

Rentabilidad*	31-jul-22	31-ago-22	30-sep-22	Variación
Mensual	2,22%	-2,37%	-3,92%	-65,5%
12 Meses	-9,08%	-11,31%	-13,72%	-21,3%
2 Años Anualizada	-3,43%	-4,47%	-6,20%	-38,6%
3 Años Anualizada	1,05%	-0,47%	-1,68%	-256,2%



TOP 10 Mayores Posiciones %**	
MONEY MARKET FUND	9,91%
USA TREASURY 0,75% 31/12/2023	2,65%
USA TREASURY 2,125% 30/11/2024	2,12%
USA TREASURY 2,875% 30/04/2025	1,75%
USA TREASURY 0,25% 15/06/2024	1,75%
USA TREASURY 1,875% 31/08/2024	1,62%
USA TREASURY 0,75% 31/08/2026	1,53%
USA TREASURY 0,25% 31/07/2025	1,51%
USA TREASURY 2,875% 31/05/2025	1,26%
USA TREASURY 0,375% 15/04/2024	1,23%
TOTAL	25,33%

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.