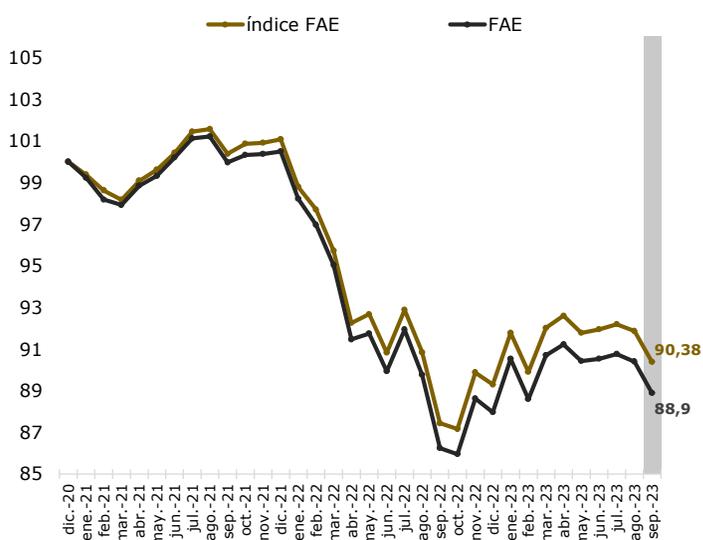


## FONDO DE AHORRO Y ESTABILIZACIÓN - FAE

### INFORME: SEPTIEMBRE 2023

**Comportamiento del Fondo**  
(Base 100 = 31 Dic 2020)



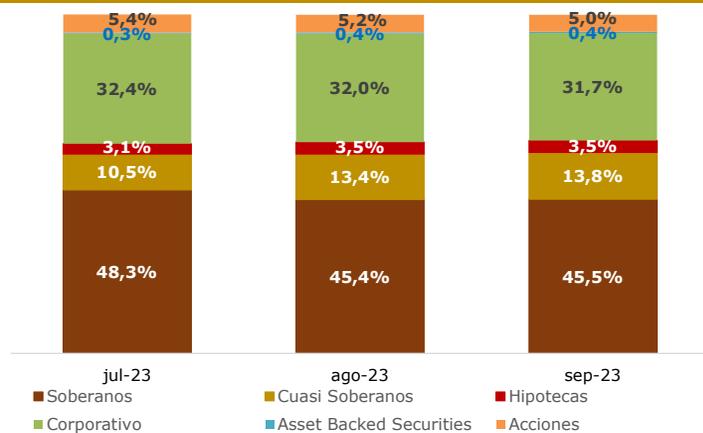
#### Estadísticas

Estadísticas	31-jul-23	31-ago-23	30-sep-23	Variación
Activos Netos (USD Millones)	4.126,0	4.129,9	4.111,1	-0,46%
Valor Unidad (USD \$)	1.160,6	1.159,1	1.152,5	-0,57%
Volatilidad Mensual	0,09%	0,46%	0,90%	93,76%
Volatilidad 12 meses	2,16%	2,04%	1,72%	-15,79%
Treynor Ratio	-0,20	-0,13	-0,06	52,83%
Sharpe Ratio	-2,69	-1,97	-1,05	46,41%
Beta	0,30	0,30	0,29	-4,34%
Duración	4,42	4,22	4,09	-3,08%
Vencimiento Medio	6,44	6,20	6,00	-3,23%

#### Rentabilidad\*

Rentabilidad*	31-jul-23	31-ago-23	30-sep-23	Variación
Mensual	0,25%	-0,40%	-1,68%	-315,59%
12 Meses	-1,27%	0,71%	3,06%	329,65%
2 Años Anualizada	-5,26%	-5,49%	-5,70%	-3,89%
3 Años Anualizada	-2,71%	-2,77%	-3,21%	-15,69%

#### Composición\*



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

MONEY MARKET FUND	9,86%
USA TREASURY 4,625% 30/06/2025	5,73%
USA TREASURY 1,875% 30/06/2026	3,48%
USA TREASURY 0,375% 30/04/2025	2,55%
USA TREASURY 2,125% 30/11/2024	2,25%
USA TREASURY 2,375% 30/04/2026	1,41%
USA TREASURY 4,125% 15/06/2026	1,32%
USA TREASURY 3,5% 15/02/2033	1,22%
USA TREASURY 0% 19/10/2023	1,08%
USA TREASURY 0,75% 31/03/2026	1,03%

#### TOTAL

**29,92%**

\*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.