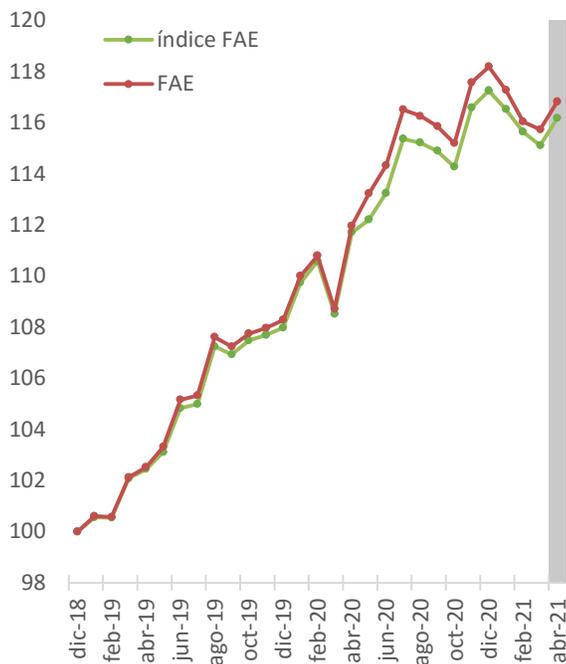


FONDO DE AHORRO Y ESTABILIZACIÓN - FAE

INFORME: ABRIL 2021

Comportamiento del Fondo (Base 100 = 31 Dic 2018)



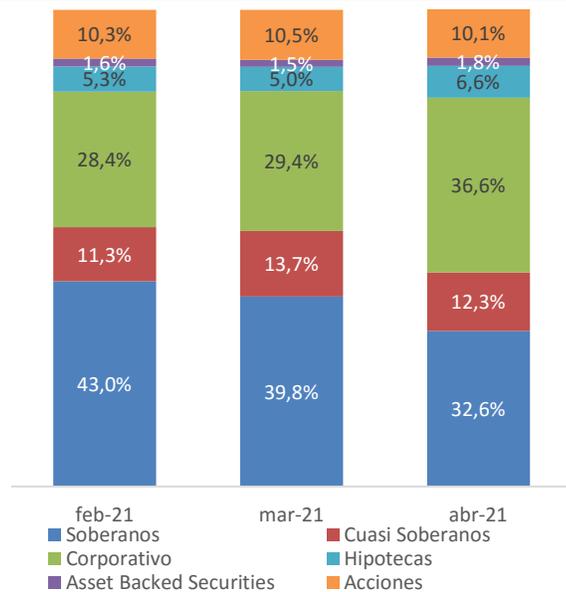
Estadísticas

Estadísticas	28-feb-21	31-mar-21	30-abr-21*	Variación
Activos Netos (USD Millones)	4002,7	4006,0	3643,6	-9,0%
Valor Unidad (USD \$)	1177,6	1176,8	1179,9	0,3%
Volatilidad Mensual	0,20%	0,56%	0,85%	52,4%
Volatilidad 12 meses	1,45%	1,29%	1,05%	-18,8%
Sharpe Ratio	3,17	4,92	4,05	-17,7%
Beta	0,14	0,17	0,20	13,9%
Duración	4,32	4,24	5,17	21,9%
Vencimiento Medio	6,42	6,31	7,58	20,1%

Rentabilidad**

Rentabilidad**	28-feb-21	31-mar-21	30-abr-21	Variación
Mensual	-1,06%	-0,26%	0,94%	457,2%
12 Meses	4,73%	6,45%	4,34%	-32,8%
2 Años Anualizada	7,42%	6,45%	6,74%	4,5%
3 Años Anualizada	6,00%	5,70%	6,18%	8,5%

Composición**



TOP 10 Mayores Posiciones %***

STATE STREET CORP	5,07%
MONEY MARKET FUND	4,13%
USA TREASURY 1,875% 30/04/2022	2,83%
USA TREASURY 0,25% 15/04/2023	2,77%
USA TREASURY 2,125% 31/12/2022	1,95%
USA TREASURY 1,375% 15/10/2022	1,93%
USA TREASURY 0,25% 15/06/2023	1,66%
USA TREASURY 2,25% 31/12/2023	1,62%
USA TREASURY 2,875% 31/05/2025	1,44%
OeKB Vienna 2,875% 13/03/2023	1,26%
TOTAL	24,66%

Fuente: Banrep, Bloomberg, Cálculos Grupo Financiero Asesor

*En virtud de lo dispuesto en el decreto 332 de 2021, el 23 de abril se efectuó un retiro de USD 375.937.914,75.

**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.