

FONDO DE AHORRO Y ESTABILIZACIÓN - FAE

INFORME: MARZO 2022

Comportamiento del Fondo
(Base 100 = 31 Dic 2019)



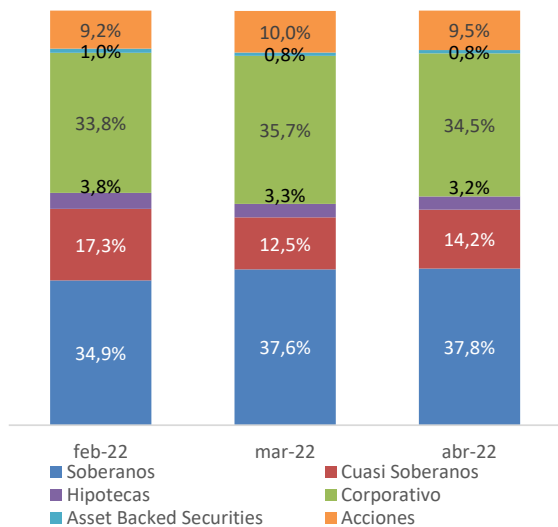
Estadísticas

Estadísticas	28-feb-22	31-mar-22	30-abr-22	Variación
Activos Netos (USD Millones)	3.675,5	3.665,8	3.644,8	-0,6%
Valor Unidad (USD \$)	1.175,3	1.170,6	1.161,9	-0,7%
Volatilidad Mensual	0,70%	0,51%	1,24%	142,2%
Volatilidad 12 meses	1,01%	1,15%	1,46%	27,6%
Sharpe Ratio	-1,34	-2,70	-5,24	-94,0%
Beta	0,19	0,17	0,24	40,9%
Duración	5,39	5,21	4,99	-4,2%
Vencimiento Medio	7,77	7,55	7,30	-3,3%

Rentabilidad*

Rentabilidad*	28-feb-22	31-mar-22	30-abr-22	Variación
Mensual	-1,27%	-2,00%	-3,75%	-88,0%
12 Meses	-1,23%	-2,95%	-7,47%	-153,1%
2 Años Anualizada	1,71%	1,64%	-1,74%	-205,9%
3 Años Anualizada	4,45%	3,22%	1,78%	-44,8%

Composición*



TOP 10 Mayores Posiciones %**

MONEY MARKET FUND	7,60%
USA TREASURY 0,375% 15/04/2024	2,30%
USA TREASURY 2,125% 30/11/2024	2,17%
USA TREASURY 0,25% 15/06/2024	1,77%
USA TREASURY 1,875% 31/08/2024	1,66%
USA TREASURY 0,25% 15/06/2023	1,61%
USA TREASURY 2,875% 31/05/2025	1,31%
USA TREASURY 1,125% 31/08/2028	1,29%
USA TREASURY 0,125% 15/08/2023	1,29%
USA TREASURY 2,25% 31/12/2023	1,20%
TOTAL	22,21%

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.