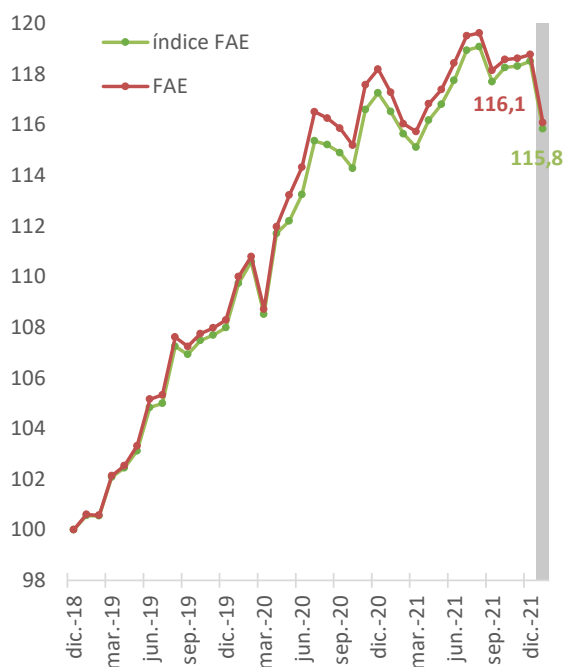


FONDO DE AHORRO Y ESTABILIZACIÓN - FAE

INFORME: ENERO 2022

Comportamiento del Fondo
(Base 100 = 31 Dic 2018)



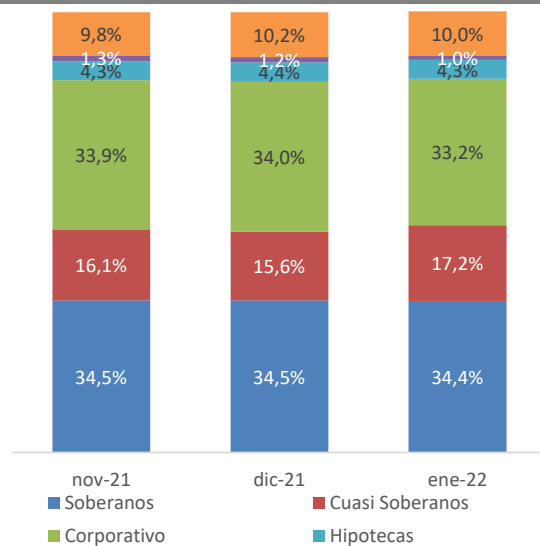
Estadísticas

	30-nov-21	31-dic-21	31-ene-22	Variación
Activos Netos (USD Millones)	3.683,6	3.690,0	3.678,2	-0,3%
Valor Unidad (USD \$)	1.183,4	1.183,7	1.178,3	-0,5%
Volatilidad Mensual	0,22%	0,06%	1,69%	2908,7%
Volatilidad 12 meses	0,76%	0,75%	0,98%	31,4%
Sharpe Ratio	1,08	0,55	-1,13	-303,4%
Beta	0,17	0,13	0,18	41,4%
Duración	5,31	5,34	5,17	-3,2%
Vencimiento Medio	7,58	7,72	7,48	-3,1%

Rentabilidad*

	30-nov-21	31-dic-21	31-ene-22	Variación
Mensual	0,05%	0,13%	-2,27%	-1912,0%
12 Meses	0,89%	0,49%	-1,02%	-306,9%
2 Años Anualizada	4,82%	4,73%	2,73%	-42,4%
3 Años Anualizada	6,31%	5,90%	4,89%	-17,2%

Composición*



Fuente: Banrep, Bloomberg, Cálculos Grupo Financiero Asesor

TOP 10 Mayores Posiciones %**

MONEY MARKET FUND	15,40%
USA TREASURY 0,25% 15/04/2023	2,95%
USA TREASURY 0,375% 15/04/2024	2,27%
USA TREASURY 2,125% 30/11/2024	2,16%
USA TREASURY 0,25% 15/06/2024	1,74%
USA TREASURY 1,875% 31/08/2024	1,66%
USA TREASURY 0,25% 15/06/2023	1,56%
USA TREASURY 1,125% 31/08/2028	1,34%
USA TREASURY 2,875% 31/05/2025	1,30%
USA TREASURY 0,125% 15/08/2023	1,25%
TOTAL	31,63%

*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.