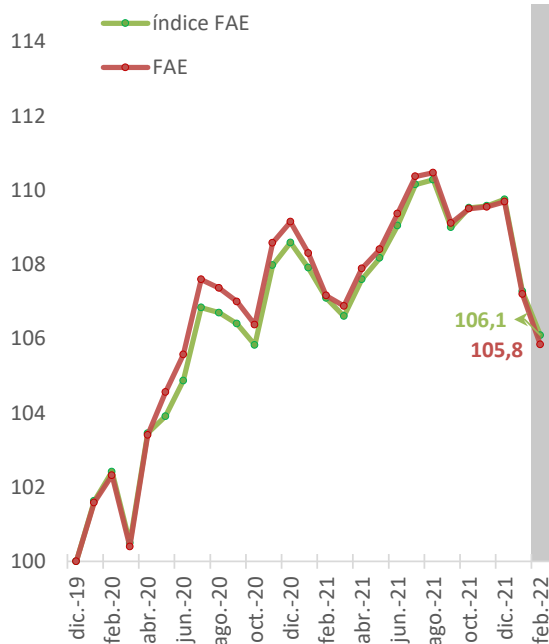


FONDO DE AHORRO Y ESTABILIZACIÓN - FAE

INFORME: FEBRERO 2022

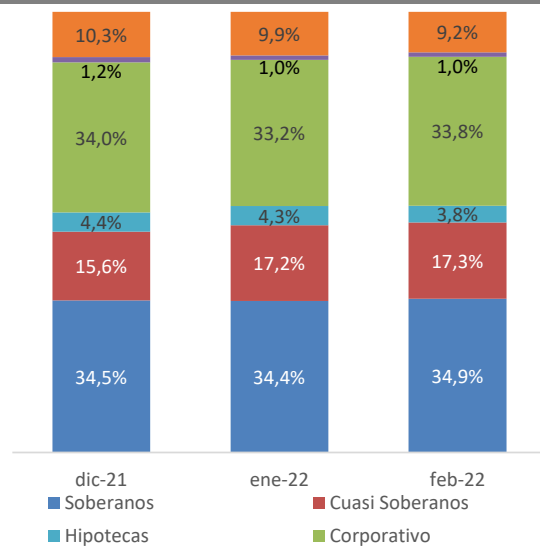
Comportamiento del Fondo (Base 100 = 31 Dic 2019)



Estadísticas	31-dic-21	31-ene-22	28-feb-22	Variación
Activos Netos (USD Millones)	3.690,0	3.678,2	3.675,5	-0,1%
Valor Unidad (USD \$)	1.183,7	1.178,3	1.175,3	-0,3%
Volatilidad Mensual	0,06%	1,69%	0,70%	-58,4%
Volatilidad 12 meses	0,75%	0,98%	1,01%	2,1%
Sharpe Ratio	0,55	-1,13	-1,34	-18,7%
Beta	0,13	0,18	0,19	2,7%
Duración	5,34	5,17	4,82	-6,8%
Vencimiento Medio	7,72	7,48	6,89	-7,9%

Rentabilidad*	31-dic-21	31-ene-22	28-feb-22	Variación
Mensual	0,13%	-2,27%	-1,27%	43,9%
12 Meses	0,49%	-1,02%	-1,23%	-21,1%
2 Años Anualizada	4,73%	2,73%	1,71%	-37,4%
3 Años Anualizada	5,90%	4,89%	4,45%	-8,9%

Composición*



Fuente: Banrep, Bloomberg, Cálculos Grupo Financiero Asesor

TOP 10 Mayores Posiciones %**

MONEY MARKET FUND	12,16%
USA TREASURY 0,375% 15/04/2024	2,26%
USA TREASURY 2,125% 30/11/2024	2,14%
USA TREASURY 0,25% 15/04/2023	2,10%
USA TREASURY 0,25% 15/06/2024	1,74%
USA TREASURY 1,875% 31/08/2024	1,63%
USA TREASURY 0,25% 15/06/2023	1,56%
USA TREASURY 1,125% 31/08/2028	1,33%
USA TREASURY 2,875% 31/05/2025	1,29%
USA TREASURY 0,125% 15/08/2023	1,25%
TOTAL	27,45%

*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.