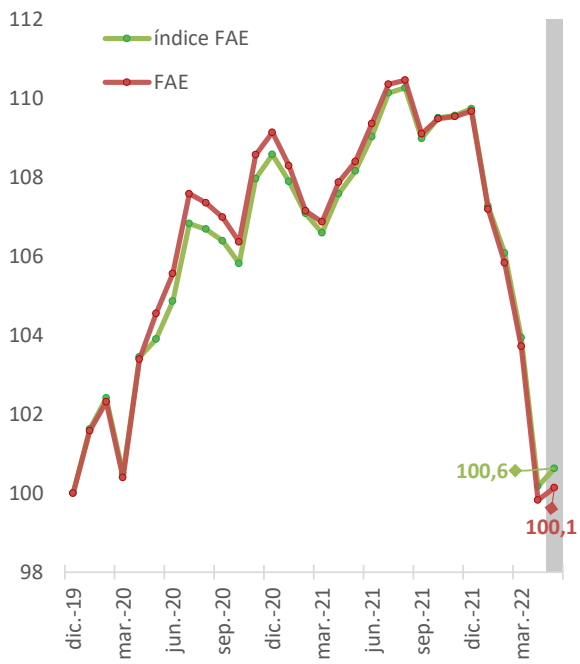
FONDO DE AHORRO Y ESTABILIZACIÓN - FAE

INFORME: MAYO 2022

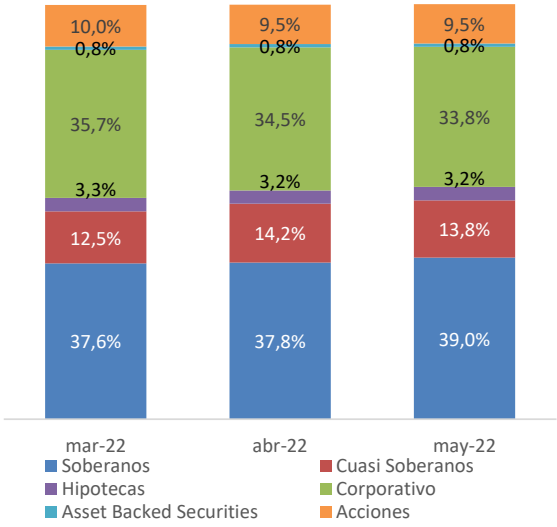
Comportamiento del Fondo (Base 100 = 31 Dic 2019)



Estadísticas	31-mar-22	30-abr-22	31-may-22	Variación
Activos Netos (USD Millones)	3.665,8	3.644,8	3.654,1	0,3%
Valor Unidad (USD $)	1.170,6	1.161,9	1.162,7	0,1%
Volatilidad Mensual	0,51%	1,24%	2,88%	131,5%
Volatilidad 12 meses	1,15%	1,46%	1,45%	-0,7%
Sharpe Ratio	-2,70	-5,24	-5,43	-3,8%
Beta	0,17	0,24	0,23	-2,7%
Duración	5,21	4,99	4,90	-1,8%
Vencimiento Medio	7,55	7,30	7,23	-1,0%

Rentabilidad*	31-mar-22	30-abr-22	31-may-22	Variación
Mensual	-2,00%	-3,75%	0,31%	108,4%
12 Meses	-2,95%	-7,47%	-7,62%	-2,1%
2 Años Anualizada	1,64%	-1,74%	-2,13%	-22,4%
3 Años Anualizada	3,22%	1,78%	1,63%	-8,5%

Composición*



Fuente: Banrep, Bloomberg, Cálculos Grupo Financiero Asesor

TOP 10 Mayores Posiciones %**

MONEY MARKET FUND	6,45%
USA TREASURY 0,75% 31/12/2023	2,66%
USA TREASURY 2,125% 30/11/2024	2,14%
USA TREASURY 0,25% 15/06/2024	1,76%
USA TREASURY 1,875% 31/08/2024	1,65%
USA TREASURY 0,75% 31/08/2026	1,57%
USA TREASURY 0,125% 15/07/2023	1,51%
USA TREASURY 1,125% 31/08/2028	1,28%
USA TREASURY 2,875% 31/05/2025	1,28%
USA TREASURY 0,125% 15/08/2023	1,27%
TOTAL	**21,57%**

*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.