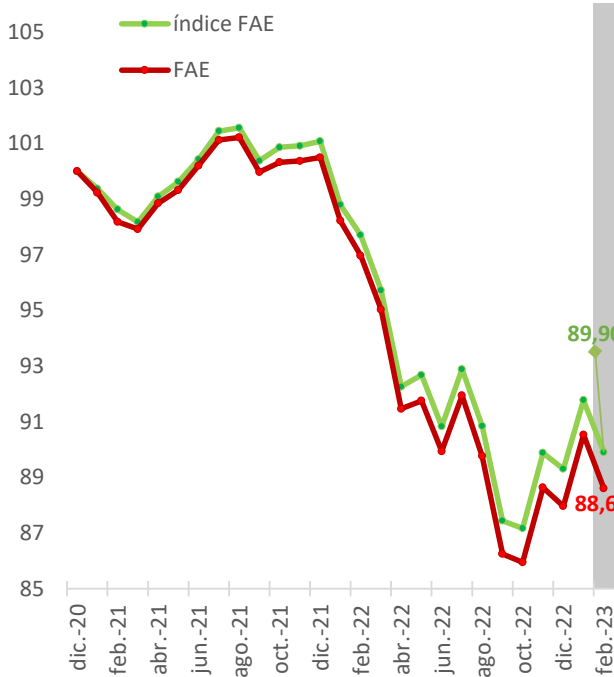


FONDO DE AHORRO Y ESTABILIZACIÓN - FAE

INFORME: FEBRERO 2023

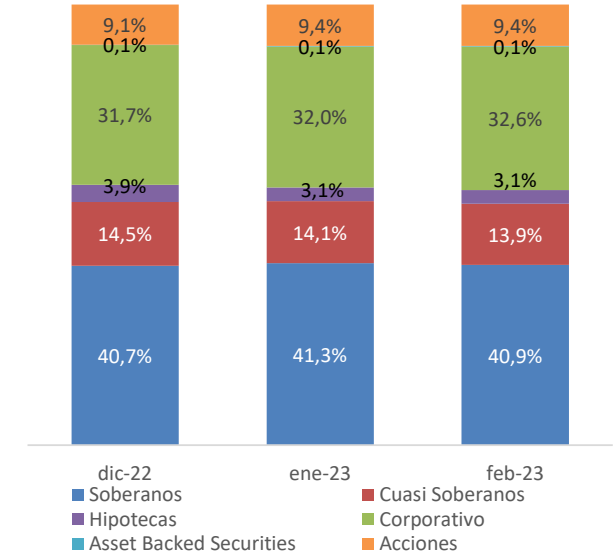
Comportamiento del Fondo
(Base 100 = 31 Dic 2020)



Estadísticas	31-dic-22	31-ene-23	28-feb-23	Variación
Activos Netos (USD Millones)	3.641,4	3.661,7	3.646,5	-0,4%
Valor Unidad (USD \$)	1.153,2	1.159,7	1.154,9	-0,4%
Volatilidad Mensual	2,74%	2,60%	3,57%	37,4%
Volatilidad 12 meses	2,16%	2,40%	2,43%	1,4%
Sharpe Ratio	-6,82	-4,38	-4,80	-9,6%
Beta	0,25	0,28	0,28	0,2%
Duración	4,45	4,60	4,48	-2,6%
Vencimiento Medio	6,67	6,82	6,76	-0,9%

Rentabilidad*	31-dic-22	31-ene-23	28-feb-23	Variación
Mensual	-0,75%	2,92%	-2,13%	-172,9%
12 Meses	-12,47%	-7,82%	-8,62%	-10,2%
2 Años Anualizada	-6,21%	-4,48%	-5,00%	-11,5%
3 Años Anualizada	-1,35%	-0,92%	-1,86%	-102,6%

Composición*



Fuente: Banrep, Bloomberg, Cálculos Grupo Financiero Asesor

TOP 10 Mayores Posiciones %**	
MONEY MARKET FUND	8,32%
USA TREASURY 2.125% 30/11/2024	2,15%
FEDERAL NATIONAL MORTGAGE 2% 01/03/2052	1,96%
USA TREASURY 2.875% 31/05/2025	1,95%
USA TREASURY 2.375% 15/08/2024	1,93%
USA TREASURY 0.25% 15/06/2024	1,79%
USA TREASURY 2.875% 30/04/2025	1,77%
USA TREASURY 1.875% 31/08/2024	1,64%
USA TREASURY 2.125% 31/03/2024	1,57%
USA TREASURY 0.75% 31/08/2026	1,56%
TOTAL	24,64%

*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.