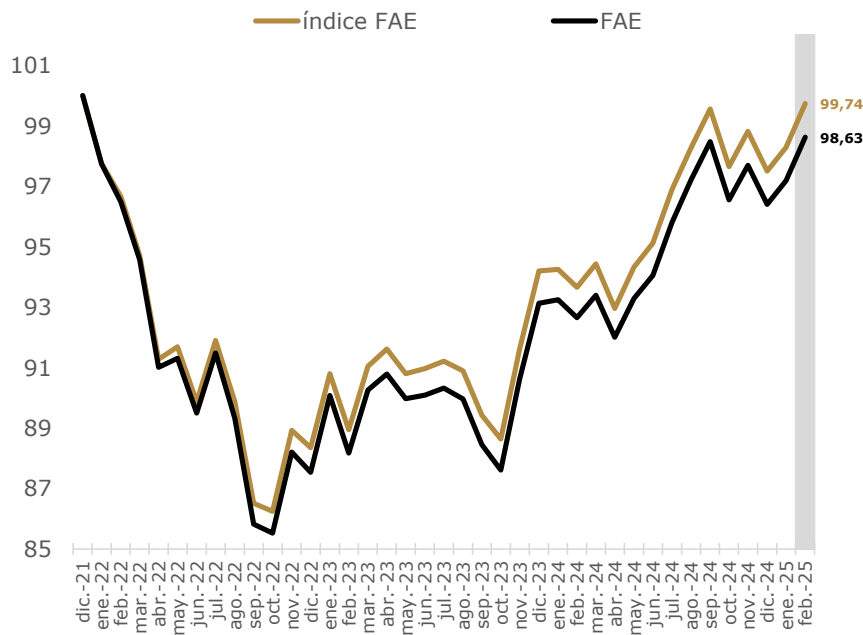
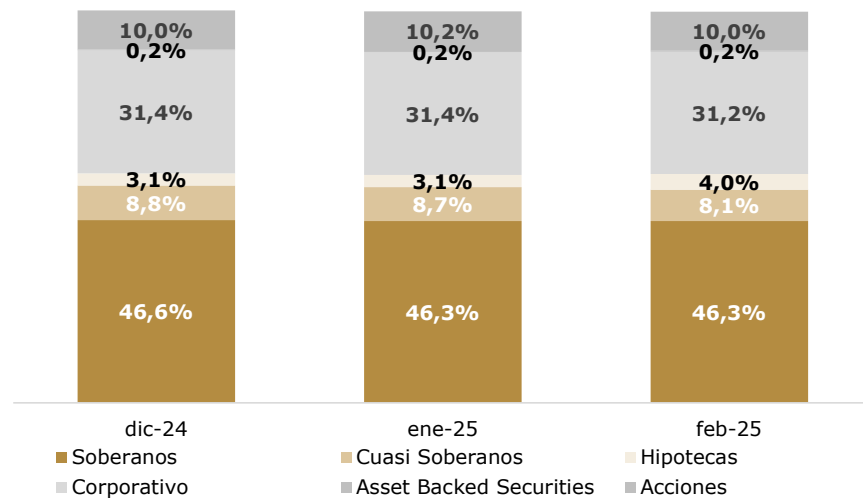


FONDO DE AHORRO Y ESTABILIZACIÓN - FAE

INFORME: FEBRERO 2025

Comportamiento del Fondo
(Base 100 = 31 Dic 2021)

Composición*



Fuente: Banrep, Bloomberg, Cálculos Grupo Financiero Asesor

Estadísticas

	31-dic-24	31-ene-25	28-feb-25	Variación
Activos Netos (USD Millones)	4.403	4.417	4.449	0,72%
Valor Unidad (USD \$)	1.188	1.192	1.199	0,57%
Activos Portafolio (USD Millones)	1.675	1.668	1.720	3,12%
Volatilidad Mensual	1,77%	1,51%	0,48%	-68,32%
Volatilidad 12 meses	1,32%	1,33%	1,32%	-0,18%
Treynor Ratio	-0,04	-0,01	0,08	691,32%
Sharpe Ratio	-0,88	-0,30	1,42	574,64%
Beta	0,32	0,28	0,23	-19,87%
Duración	4,45	4,30	4,53	5,35%
Vencimiento Medio	6,87	6,63	7,00	5,58%

Rentabilidad*

	31-dic-24	31-ene-25	28-feb-25	Variación
Mensual	-1,32%	0,81%	1,48%	83,33%
12 Meses	3,51%	4,22%	6,44%	52,65%
2 Años Anualizada	4,94%	3,86%	5,76%	49,12%
3 Años Anualizada	-1,21%	-0,19%	0,73%	488,51%

TOP 10 Mayores Posiciones %**

MONEY MARKET FUND	5,69%
USA TREASURY 4,625% 15/10/2026	2,23%
USA TREASURY 4,375% 15/05/2034	1,50%
USA TREASURY 1,125% 29/02/2028	1,43%
USA TREASURY 2,375% 31/03/2029	1,30%
USA TREASURY 2,375% 15/05/2027	1,26%
USA TREASURY 2,375% 30/04/2026	1,25%
USA TREASURY 2,75% 30/04/2027	1,17%
USA TREASURY 2,25% 15/02/2027	1,11%
USA TREASURY 3,75% 30/06/2030	1,10%

TOTAL

18,04%

*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.