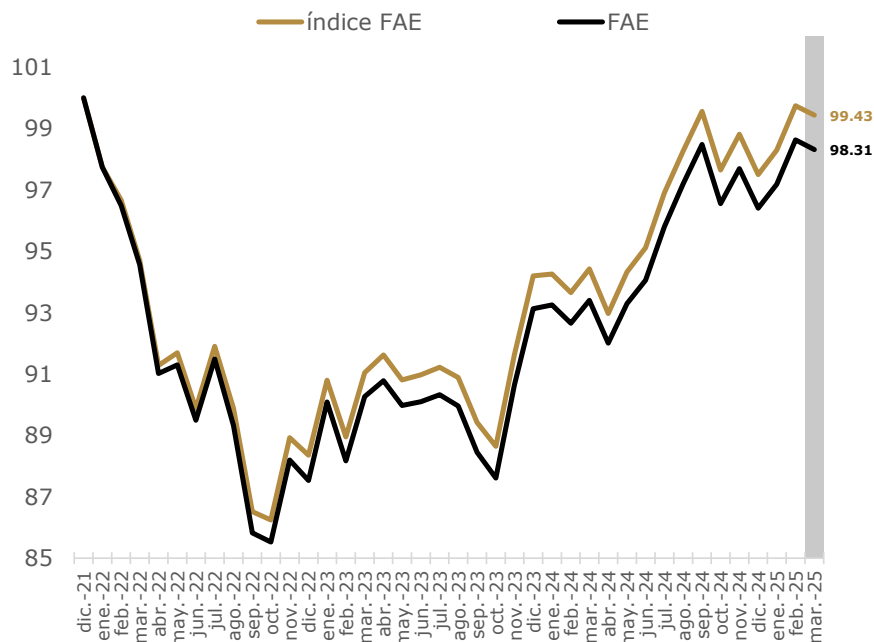
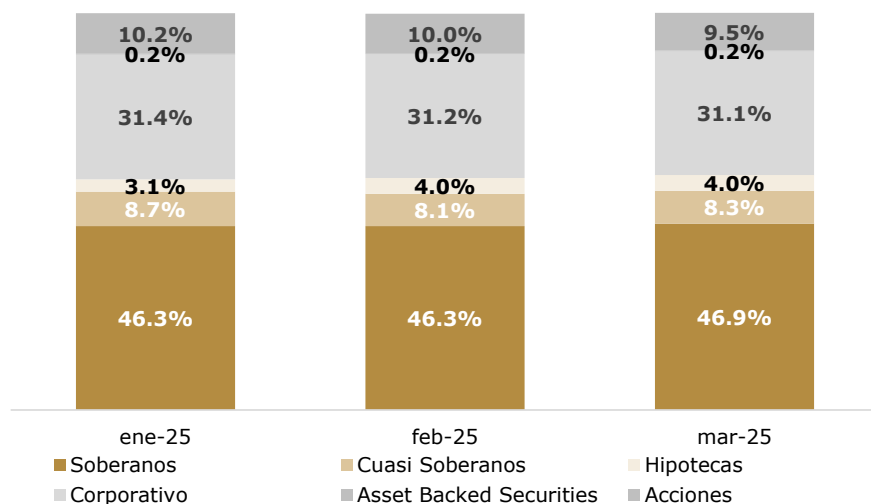


FONDO DE AHORRO Y ESTABILIZACIÓN - FAE

INFORME: MARZO 2025

Comportamiento del Fondo
(Base 100 = 31 Dic 2021)

Composición*



Estadísticas

	31-ene-25	28-feb-25	31-mar-25	Variación
Activos Netos (USD Millones)	4,417	4,449	4,447	-0.03%
Valor Unidad (USD \$)	1,192	1,199	1,197	-0.12%
Activos Portafolio (USD Millones)	1,668	1,720	1,719	-0.07%
Volatilidad Mensual	1.51%	0.48%	1.28%	167.24%
Volatilidad 12 meses	1.33%	1.32%	1.34%	1.39%
Treynor Ratio	-0.01	0.08	0.03	-61.26%
Sharpe Ratio	-0.30	1.42	0.58	-59.28%
Beta	0.28	0.23	0.24	6.59%
Duración	4.30	4.53	4.59	1.32%
Vencimiento Medio	6.63	7.00	7.20	2.86%

Rentabilidad*

	31-ene-25	28-feb-25	31-mar-25	Variación
Mensual	0.81%	1.48%	-0.32%	-121.47%
12 Meses	4.22%	6.44%	5.26%	-18.38%
2 Años Anualizada	3.86%	5.76%	4.36%	-24.26%
3 Años Anualizada	-0.19%	0.73%	1.30%	78.12%

TOP 10 Mayores Posiciones %**

MONEY MARKET FUND	6.04%
USA TREASURY 4,625% 15/10/2026	2.24%
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	1.29%
USA TREASURY 2,375% 15/05/2027	1.26%
USA TREASURY 0,625% 31/03/2027	1.24%
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	1.11%

TOTAL

18.37%

Fuente: Banrep, Bloomberg, Cálculos Grupo Financiero Asesor

*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.