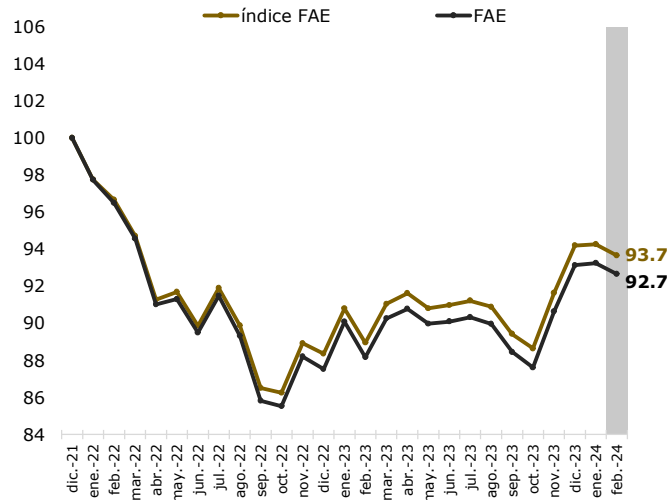


FONDO DE AHORRO Y ESTABILIZACIÓN - FAE

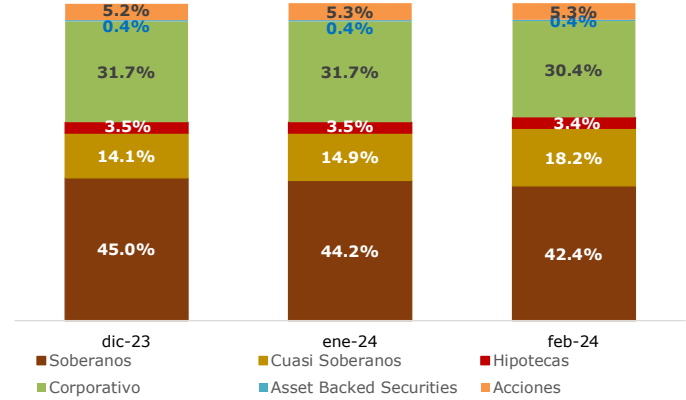
INFORME: FEBRERO 2024

Comportamiento del Fondo
(Base 100 = 31 Dic 2021)



Estadísticas	31-dic-23	31-ene-24	29-feb-24	Variación
Activos Netos (USD Millones)	4,209	4,219	4,275	1.32%
Valor Unidad (USD \$)	1,173	1,174	1,171	-0.22%
Activos Portafolio (USD Millones)	1,480	1,491	1,547	3.73%
Volatilidad Mensual	0.50%	1.86%	0.54%	-71.16%
Volatilidad 12 meses	1.90%	1.75%	1.61%	-8.05%
Treynor Ratio	0.04	-0.04	0.00	102.07%
Sharpe Ratio	0.71	-0.88	0.02	101.90%
Beta	0.33	0.38	0.32	-15.66%
Duración	4.13	4.05	3.86	-4.69%
Vencimiento Medio	5.99	6.01	5.65	-5.99%
Rentabilidad *	31-dic-23	31-ene-24	29-feb-24	Variación
Mensual	2.75%	0.12%	-0.63%	-612.31%
12 Meses	6.40%	3.51%	5.09%	44.94%
2 Años Anualizada	-3.49%	-2.32%	-2.01%	13.56%
3 Años Anualizada	-2.18%	-1.89%	-1.75%	7.38%

Composición*



TOP 10 Mayores Posiciones %**

MONEY MARKET FUND	14.99%
USA TREASURY 4.625% 30/06/2025	5.14%
USA TREASURY 1.875% 30/06/2026	3.64%
USA TREASURY 4.625% 15/10/2026	2.35%
USA TREASURY 2.375% 30/04/2026	1.28%
USA TREASURY 4.125% 15/06/2026	1.19%
USA TREASURY 2.25% 15/02/2027	1.14%
USA TREASURY 4% 15/01/2027	1.11%
USA TREASURY 4% 29/02/2028	1.03%
USA TREASURY 0.75% 31/03/2026	0.94%
TOTAL	32.82%

*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.