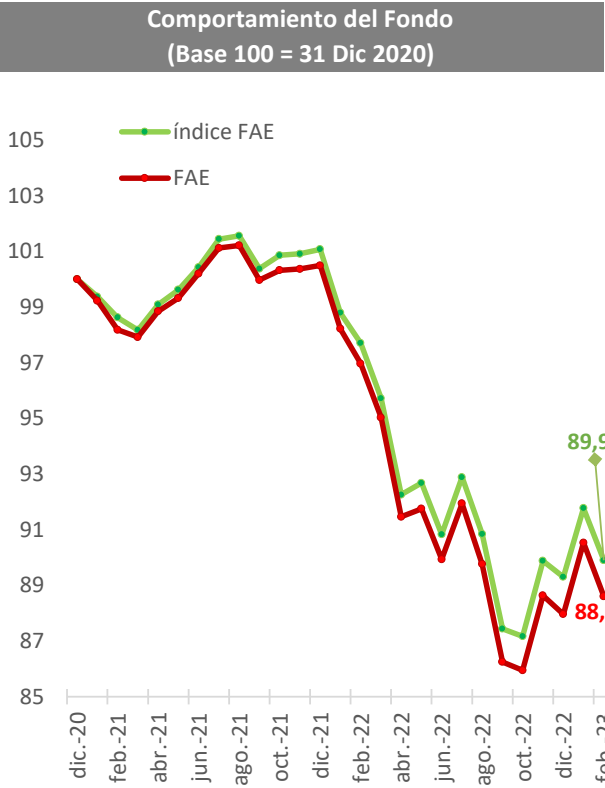


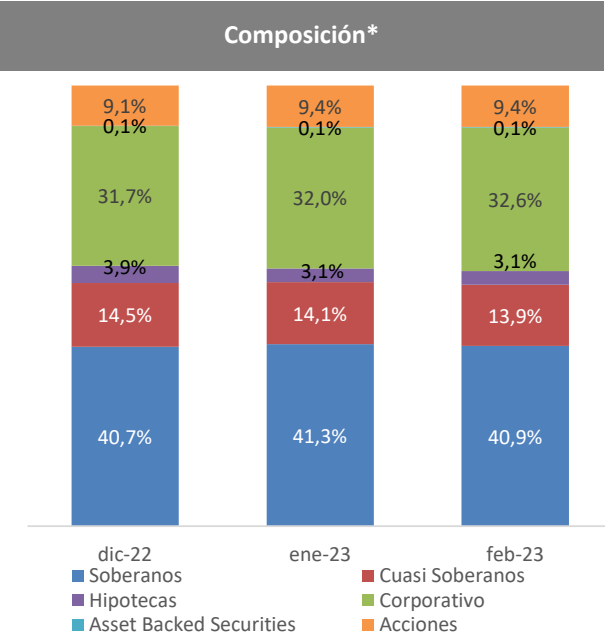
FONDO DE AHORRO Y ESTABILIZACIÓN - FAE

INFORME: FEBRERO 2023



Estadísticas	31-ene-23	28-feb-23	31-mar-23	Variación
Activos Netos (USD Millones)	3.661,7	3.646,5	3.678,9	0,9%
Valor Unidad (USD \$)	1.159,7	1.154,9	1.160,3	0,5%
Volatilidad Mensual	2,60%	3,57%	3,22%	-9,5%
Volatilidad 12 meses	2,40%	2,43%	2,56%	5,0%
Sharpe Ratio	-4,38	-4,80	-3,11	35,3%
Beta	0,28	0,28	0,30	5,3%
Duración	4,60	4,48	4,12	-8,0%
Vencimiento Medio	6,82	6,76	6,05	-10,5%

Rentabilidad*	31-ene-23	28-feb-23	31-mar-23	Variación
Mensual	2,92%	-2,13%	2,44%	214,6%
12 Meses	-7,82%	-8,62%	-4,49%	47,9%
2 Años Anualizada	-4,48%	-5,00%	-3,72%	25,5%
3 Años Anualizada	-0,92%	-1,86%	-0,44%	76,2%



Fuente: Banrep, Bloomberg, Cálculos Grupo Financiero Asesor

TOP 10 Mayores Posiciones %**	
MONEY MARKET FUND	18,83%
USA TREASURY 2,125% 30/11/2024	1,83%
USA TREASURY 2,875% 31/05/2025	1,67%
FEDERAL NATIONAL MORTGAGE 2% 01/03/2052	1,66%
USA TREASURY 2,375% 15/08/2024	1,65%
USA TREASURY 0,25% 15/06/2024	1,52%
USA TREASURY 2,875% 30/04/2025	1,51%
USA TREASURY 1,875% 31/08/2024	1,40%
USA TREASURY 0% 15/06/2023	1,37%
USA TREASURY 0,75% 31/08/2026	1,35%
TOTAL	32,78%

*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.