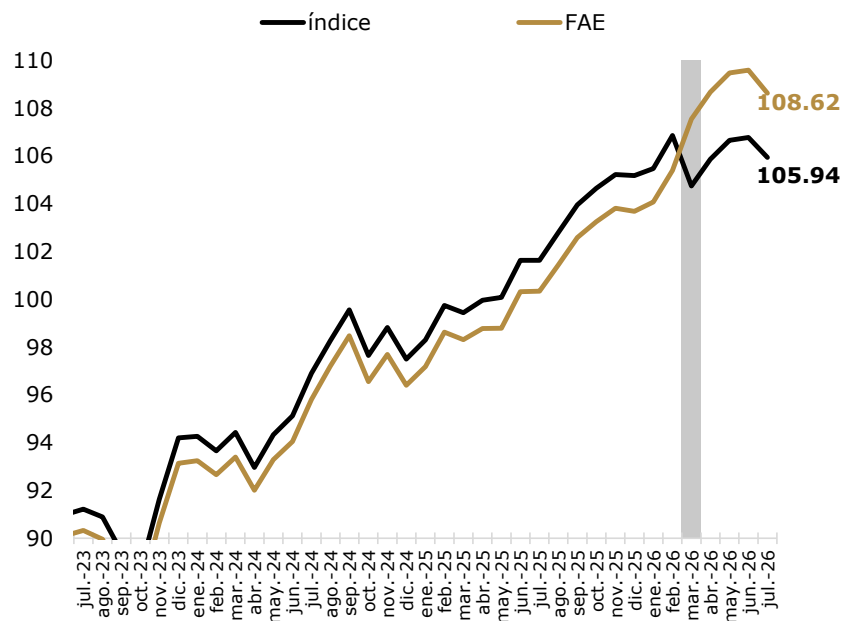


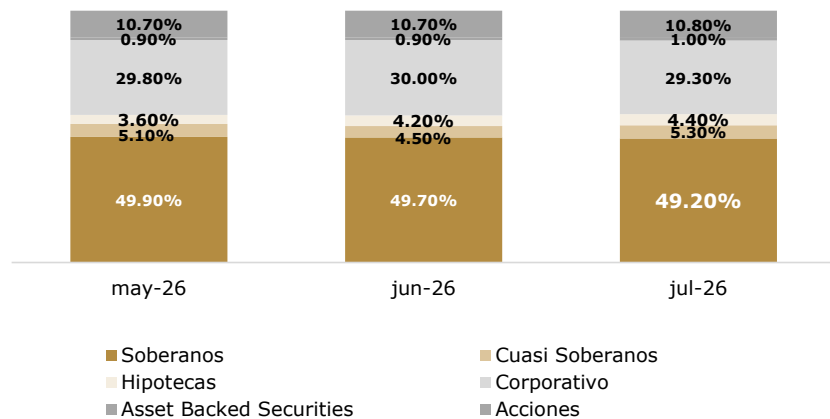
FONDO DE AHORRO Y ESTABILIZACIÓN - FAE

INFORME: JULIO 2026

Comportamiento del Fondo (Base 100 = 31 Dic 2021)



Composición*



Fuente: Banrep, Bloomberg, Cálculos Grupo Financiero Asesor

Estadísticas	31-may-26	30-jun-26	31-jul-26	Variación
Activos Netos (USD Millones)	4,638	4,646	4,635	-0.24%
Valor Unidad (USD \$)	1,229	1,230	1,226	-0.36%
Activos Portafolio (USD Millones)	1,910	1,918	1,906	-0.58%
Volatilidad Mensual	0.23%	0.45%	0.70%	55.13%
Volatilidad 12 meses	0.62%	0.62%	0.75%	22.03%
Treynor Ratio	-1.98	-11.09	-11.87	-7%
Sharpe Ratio	11.44	9.00	6.07	-32.59%
Beta	-0.04	-0.01	0.00	23.17%
Duración	4.47	4.50	4.34	-3.56%
Vencimiento Medio	7.07	7.04	6.90	-1.99%

Rentabilidad*	31-may-26	30-jun-26	31-jul-26	Variación
Mensual	0.74%	0.10%	-0.88%	-954.9%
12 Meses	10.82%	9.24%	8.26%	-10.68%
2 Años Anualizada	8.33%	7.94%	6.48%	-18.40%
3 Años Anualizada	6.76%	6.75%	6.34%	-5.99%

TOP 10 Mayores Posiciones %**

MONEY MARKET FUND	3.31%
USA TREASURY 2,375% 31/03/2029	1.65%
USA TREASURY 3,625% 31/05/2028	1.46%
USA TREASURY 3,75% 15/04/2028	1.35%
USA TREASURY 1,125% 29/02/2028	1.35%
USA TREASURY 6,125% 15/11/2027	1.28%
USA TREASURY 3,625% 31/10/2030	1.28%
USA TREASURY 2,875% 30/04/2029	1.25%
USA TREASURY 2,75% 31/05/2029	1.22%
USA TREASURY 4,125% 31/10/2027	1.16%
TOTAL	15.31%

*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.