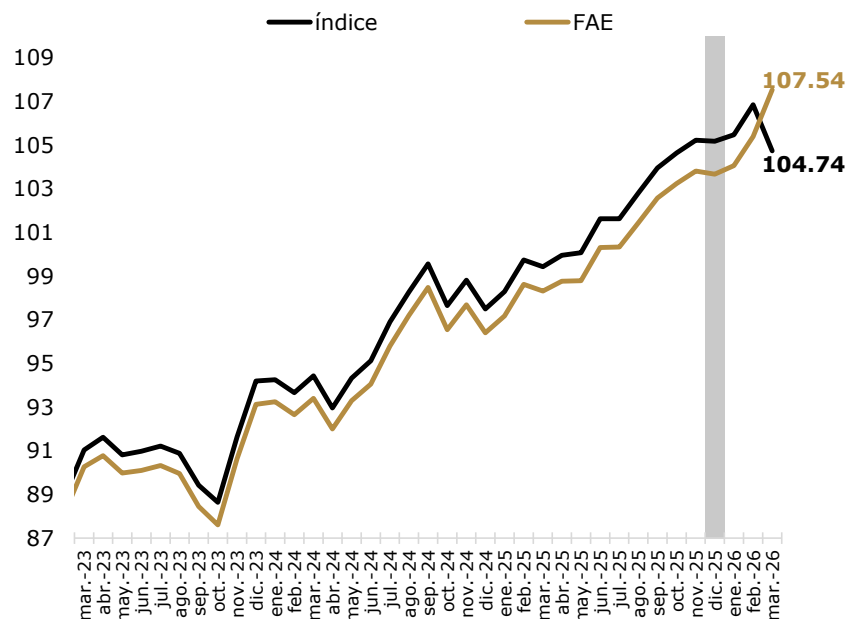


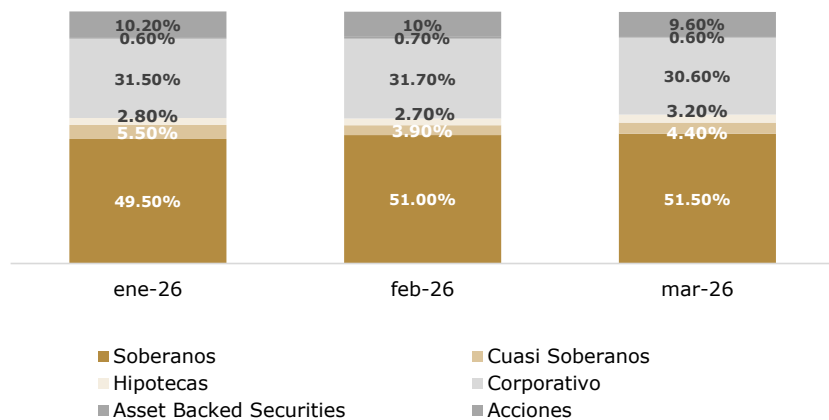
FONDO DE AHORRO Y ESTABILIZACIÓN - FAE

INFORME: MARZO 2026

Comportamiento del Fondo (Base 100 = 31 Dic 2021)



Composición*



Fuente: Banrep, Bloomberg, Cálculos Grupo Financiero Asesor

Estadísticas

	31-ene-25	28-feb-26	31-mar-26	Variación
Activos Netos (USD Millones)	4,417	4,629	4,594	-0.75%
Valor Unidad (USD \$)	1,192	1,231	1,221	-0.84%
Activos Portafolio (USD Millones)	1,668	1,901	1,866	-1.82%
Volatilidad Mensual	1.51%	0.63%	0.54%	-15.02%
Volatilidad 12 meses	1.33%	0.60%	0.67%	11.38%
Treynor Ratio	-0.01	0.61	-11.40	-1963%
Sharpe Ratio	-0.30	5.12	8.42	64.49%
Beta	0.28	0.05	0.00	-109.83%
Duración	4.30	4.55	4.57	0.44%
Vencimiento Medio	6.63	7.13	7.14	0.14%

Rentabilidad*

	31-ene-25	28-feb-26	31-mar-26	Variación
Mensual	0.81%	1.27%	2.03%	59.7%
12 Meses	4.22%	6.86%	9.38%	36.75%
2 Años Anualizada	3.86%	6.65%	7.30%	9.76%
3 Años Anualizada	-0.19%	6.13%	6.01%	-1.90%

TOP 10 Mayores Posiciones %**

MONEY MARKET FUND	2.28%
USA TREASURY 2,375% 31/03/2029	1.66%
USA TREASURY 3,625% 31/05/2028	1.50%
USA TREASURY 3,75% 15/04/2028	1.38%
USA TREASURY 1,125% 29/02/2028	1.35%
USA TREASURY 6,125% 15/11/2027	1.32%
USA TREASURY 0,75% 31/01/2028	1.27%
USA TREASURY 3,625% 31/10/2030	1.25%
USA TREASURY 2,375% 15/05/2027	1.18%
USA TREASURY 0,625% 15/05/2030	1.14%
TOTAL	14.33%

*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.