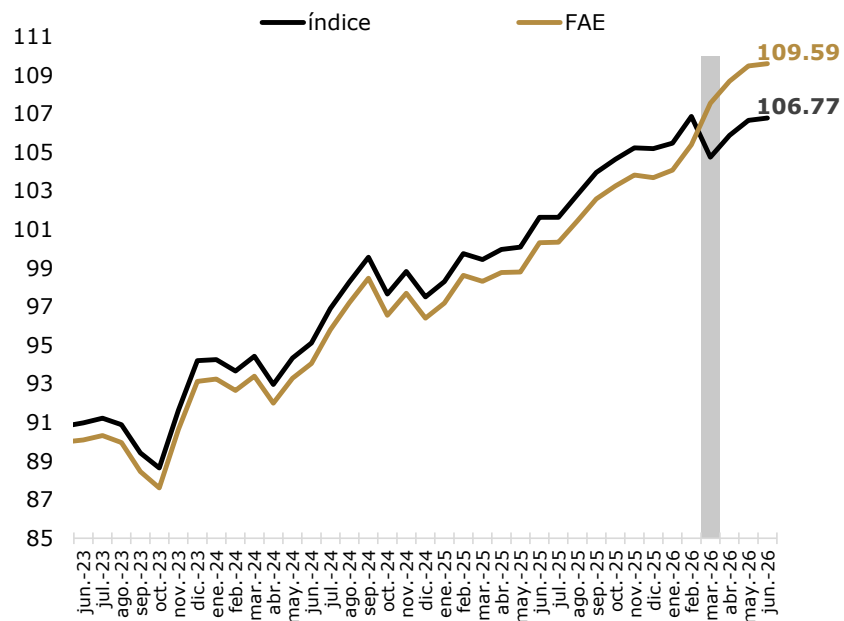


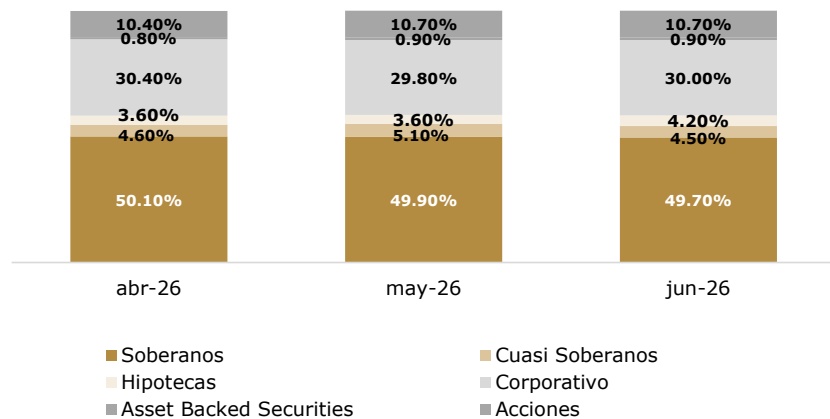
FONDO DE AHORRO Y ESTABILIZACIÓN - FAE

INFORME: JUNIO 2026

Comportamiento del Fondo (Base 100 = 31 Dic 2021)



Composición*



Fuente: Banrep, Bloomberg, Cálculos Grupo Financiero Asesor

Estadísticas

	30-abr-26	31-may-26	30-jun-26	Variación
Activos Netos (USD Millones)	4,618	4,638	4,646	0.17%
Valor Unidad (USD \$)	1,226	1,229	1,230	0.04%
Activos Portafolio (USD Millones)	1,889	1,910	1,918	0.41%
Volatilidad Mensual	0.69%	0.23%	0.45%	97.51%
Volatilidad 12 meses	0.67%	0.62%	0.62%	-0.75%
Treynor Ratio	-2.14	-1.98	-11.09	-459%
Sharpe Ratio	9.43	11.44	9.00	-21.31%
Beta	-0.03	-0.04	-0.01	86.04%
Duración	4.50	4.47	4.50	0.67%
Vencimiento Medio	7.05	7.07	7.04	-0.42%

Rentabilidad*

	30-abr-26	31-may-26	30-jun-26	Variación
Mensual	1.06%	0.74%	0.10%	-86.0%
12 Meses	10.02%	10.82%	9.24%	-14.53%
2 Años Anualizada	8.68%	8.33%	7.94%	-4.62%
3 Años Anualizada	6.18%	6.76%	6.75%	-0.14%

TOP 10 Mayores Posiciones %**

MONEY MARKET FUND	2.09%
USA TREASURY 2,375% 31/03/2029	1.64%
USA TREASURY 3,625% 31/05/2028	1.45%
USA TREASURY 3,75% 15/04/2028	1.34%
USA TREASURY 1,125% 29/02/2028	1.34%
USA TREASURY 3,625% 31/10/2030	1.27%
USA TREASURY 6,125% 15/11/2027	1.27%
USA TREASURY 2,875% 30/04/2029	1.25%
USA TREASURY 2,75% 31/05/2029	1.21%
USA TREASURY 4,125% 31/10/2027	1.15%
TOTAL	14.01%

*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.