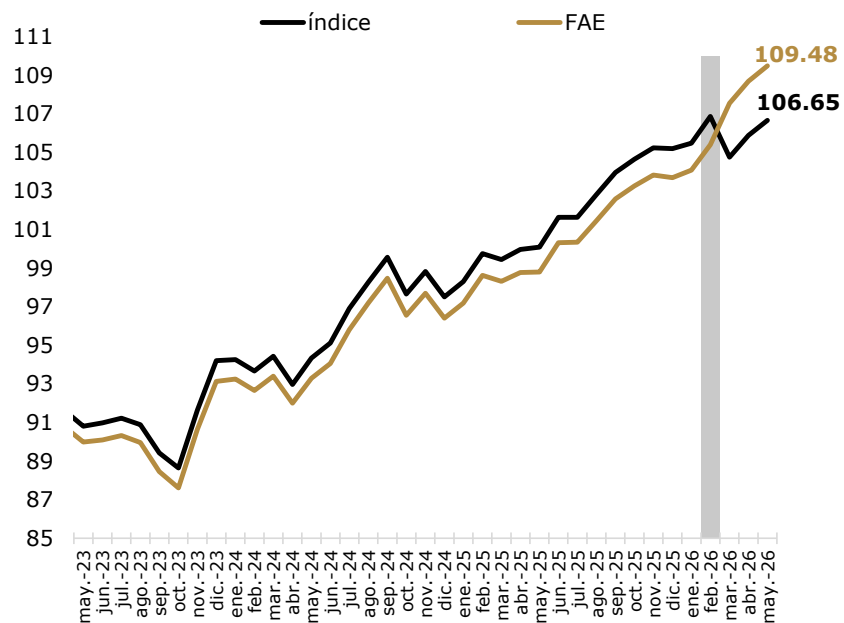


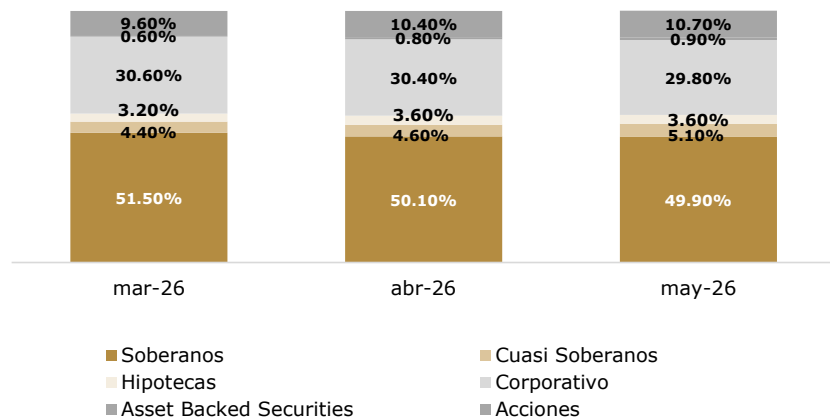
# FONDO DE AHORRO Y ESTABILIZACIÓN - FAE

## INFORME: MAYO 2026

### Comportamiento del Fondo (Base 100 = 31 Dic 2021)



### Composición\*



Fuente: Banrep, Bloomberg, Cálculos Grupo Financiero Asesor

### Estadísticas

| Estadísticas                      | 31-mar-26 | 30-abr-26 | 31-may-26 | Variación |
|-----------------------------------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| Activos Netos (USD Millones)      | 4,594     | 4,618     | 4,638     | 0.44%     |
| Valor Unidad (USD \$)             | 1,221     | 1,226     | 1,229     | 0.30%     |
| Activos Portafolio (USD Millones) | 1,866     | 1,889     | 1,910     | 1.06%     |
| Volatilidad Mensual               | 0.54%     | 0.69%     | 0.23%     | -67.08%   |
| Volatilidad 12 meses              | 0.67%     | 0.67%     | 0.62%     | -6.91%    |
| Treynor Ratio                     | -11.40    | -2.14     | -1.98     | 7%        |
| Sharpe Ratio                      | 8.42      | 9.43      | 11.44     | 21.36%    |
| Beta                              | 0.00      | -0.03     | -0.04     | -21.74%   |
| Duración                          | 4.57      | 4.50      | 4.47      | -0.67%    |
| Vencimiento Medio                 | 7.14      | 7.05      | 7.07      | 0.28%     |

### Rentabilidad\*

| Rentabilidad*     | 31-mar-26 | 30-abr-26 | 31-may-26 | Variación |
|-------------------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| Mensual           | 2.03%     | 1.06%     | 0.74%     | -30.3%    |
| 12 Meses          | 9.38%     | 10.02%    | 10.82%    | 7.91%     |
| 2 Años Anualizada | 7.30%     | 8.68%     | 8.33%     | -4.08%    |
| 3 Años Anualizada | 6.01%     | 6.18%     | 6.76%     | 9.32%     |

### TOP 10 Mayores Posiciones %\*\*

|                                |               |
|--------------------------------|---------------|
| MONEY MARKET FUND              | 3.24%         |
| USA TREASURY 2,375% 31/03/2029 | 1.65%         |
| USA TREASURY 3,625% 31/05/2028 | 1.48%         |
| USA TREASURY 3,75% 15/04/2028  | 1.35%         |
| USA TREASURY 1,125% 29/02/2028 | 1.34%         |
| USA TREASURY 6,125% 15/11/2027 | 1.27%         |
| USA TREASURY 0,75% 31/01/2028  | 1.26%         |
| USA TREASURY 2,875% 30/04/2029 | 1.25%         |
| USA TREASURY 3,625% 31/10/2030 | 1.22%         |
| USA TREASURY 4,125% 31/10/2027 | 1.15%         |
| <b>TOTAL</b>                   | <b>15.22%</b> |

\*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.