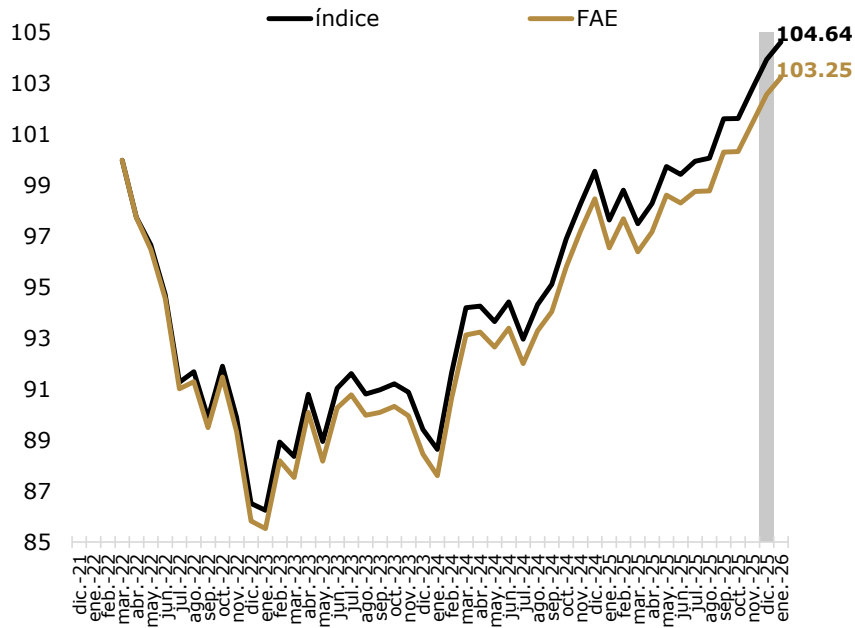


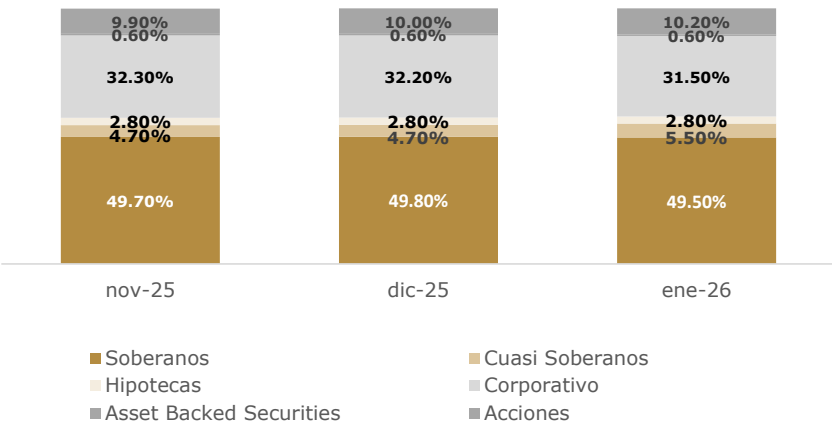
FONDO DE AHORRO Y ESTABILIZACIÓN - FAE

INFORME: ENERO 2026

Comportamiento del Fondo (Base 100 = 31 Dic 2021)



Composición*



Fuente: Banrep, Bloomberg, Cálculos Grupo Financiero Asesor

Estadísticas

Estadísticas	30-nov-25	31-dic-25	31-ene-26	Variación
Activos Netos (USD Millones)	4,587	4,589	4,601	0.26%
Valor Unidad (USD \$)	1,223	1,223	1,224	0.15%
Activos Portafolio (USD Millones)	1,859	1,860	1,872	0.65%
Volatilidad Mensual	0.07%	0.48%	0.36%	-24.79%
Volatilidad 12 meses	0.82%	0.63%	0.63%	-0.03%
Treynor Ratio	0.20	0.32	0.49	53.27%
Sharpe Ratio	2.81	5.81	5.18	-10.97%
Beta	0.11	0.11	0.07	-41.93%
Duración	4.62	4.54	4.50	-0.88%
Vencimiento Medio	7.18	7.11	7.14	0.42%

Rentabilidad*

Rentabilidad*	30-nov-25	31-dic-25	31-ene-26	Variación
Mensual	0.55%	-0.13%	0.38%	391.4%
12 Meses	6.26%	7.55%	7.08%	-6.10%
2 Años Anualizada	7.02%	5.51%	5.64%	2.44%
3 Años Anualizada	5.58%	5.80%	4.93%	-15.11%

TOP 10 Mayores Posiciones %**

MONEY MARKET FUND	3.36%
USA TREASURY 3,625% 31/05/2028	1.50%
USA TREASURY 1,125% 29/02/2028	1.36%
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	1.26%
USA TREASURY 0,625% 31/03/2027	1.18%
USA TREASURY 2,375% 15/05/2027	1.18%
USA TREASURY 2,75% 30/04/2027	1.10%
USA TREASURY 0,625% 15/05/2030	1.05%

TOTAL

14.6%

*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.