

Estrategia Propuesta para agosto 2026

Motores de decisión: La estrategia propuesta busca mantener niveles adecuados de liquidez en el portafolio para atender oportunamente los requerimientos de liquidez presupuestados. Asimismo, contempla un aumento moderado en la duración de los títulos indexados. No se plantean cambios en los porcentajes de participación de los diferentes componentes del portafolio; los ajustes se concentran en aumentar la duración de las posiciones indexadas a IPC e IBR, llevando la duración total del portafolio a 0,58 años.

TACTICAL ASSET ALLOCATION								
Asset Class	Portafolio Estrategico FJC		Estrategia Planteada			* Composición		
	Benchmark		Marco Tactico FFJC			FFJC		
	Participación %	Duración	%	Duración	OW / UW	%	Duración	OW / UW
Coltes MM	1.68%	0.90	15.00%	0.89	13%	16.88%	0.63	1.9%
Coltes UVR	0.00%	-	0.00%	-	0%	0.00%	-	0.0%
IDPFDX	60.87%	0.52	60.00%	0.67	-1%	61.48%	0.48	1.5%
Tasa Fija	21.72%	0.52	20.00%	0.40	-2%	20.28%	0.52	0.3%
IBR	7.89%	0.52	18.00%	0.80	10%	18.27%	0.49	0.3%
IPC	31.26%	0.52	22.00%	0.80	-9%	22.93%	0.45	0.9%
BENCHMARK VISTA	37.45%	0.20	25.00%	0.20	-12%	21.64%	0.24	-3.4%
Cuentas de Ahorros	18.73%	-	12.50%	0.003	-6%	8.91%	0.00	-3.6%
FICS	18.73%	0.400	12.50%	0.400	-6%	12.73%	0.40	0.2%
Total	100.00%	0.40	100.00%	0.58	0.00%	100.00%	0.46	0.00%

La información del portafolio FFJC, corresponde al corte del 30 de junio de 2026.
La composición del portafolio, el marco táctico de corto plazo y el benchmark, se encuentran alineados con la política de inversión del portafolio y su perfil de riesgo.