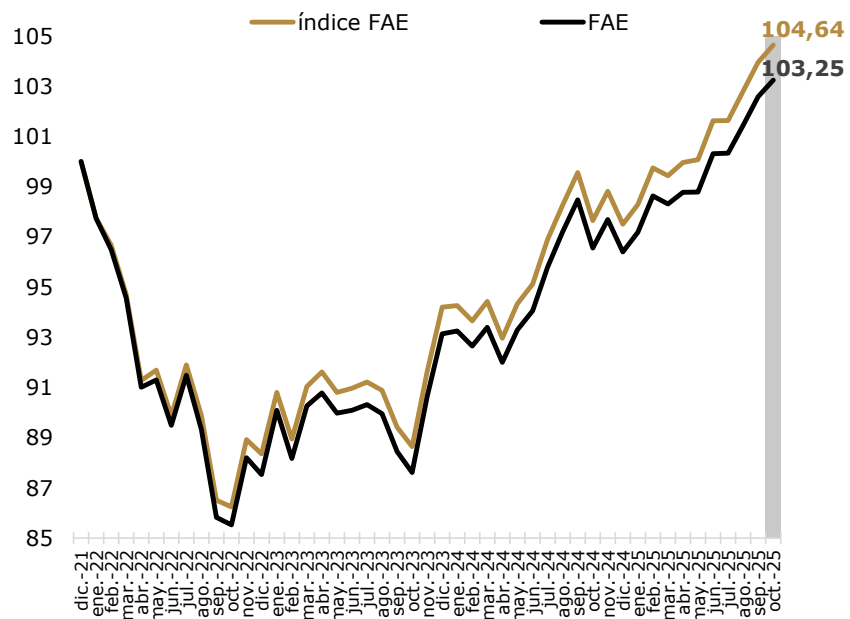


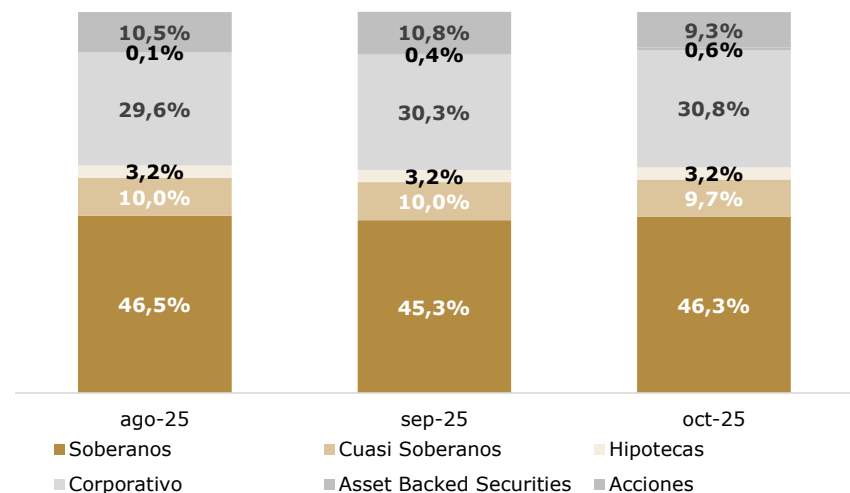
# FONDO DE AHORRO Y ESTABILIZACIÓN - FAE

## INFORME: OCTUBRE 2025

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



### Composición\*



Fuente: Banrep, Bloomberg, Cálculos Grupo Financiero Asesor

### Estadísticas

Estadísticas	31-ago-25	30-sep-25	31-oct-25	Variación
Activos Netos (USD Millones)	4.529	4.554	4.570	0,36%
Valor Unidad (USD \$)	1.212	1.217	1.221	0,26%
Activos Portafolio (USD Millones)	1.801	1.825	1.842	0,91%
Volatilidad Mensual	0,76%	0,01%	0,33%	2316,49%
Volatilidad 12 meses	1,12%	1,11%	0,84%	-24,22%
Treynor Ratio	0,02	0,01	0,19	2958,64%
Sharpe Ratio	0,23	0,09	3,46	3860,32%
Beta	0,16	0,15	0,15	-1,88%
Duración	4,20	4,16	4,69	12,74%
Vencimiento Medio	6,61	6,64	7,31	10,09%

### Rentabilidad\*

Rentabilidad*	31-ago-25	30-sep-25	31-oct-25	Variación
Mensual	1,10%	1,12%	0,65%	-42,2%
12 Meses	4,36%	4,17%	6,93%	66,40%
2 Años Anualizada	6,19%	7,69%	8,56%	11,26%
3 Años Anualizada	4,33%	6,13%	6,48%	5,76%

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

MONEY MARKET FUND	8,92%
USA TREASURY 2,75% 30/04/2027	1,67%
USA TREASURY 1,25% 31/12/2026	1,61%
USA TREASURY 3,625% 31/05/2028	1,54%
USA TREASURY 1,125% 29/02/2028	1,38%
USA TREASURY 6,125% 15/11/2027	1,37%
USA TREASURY 2,375% 31/03/2029	1,24%
USA TREASURY 2,375% 15/05/2027	1,20%
USA TREASURY 0,625% 31/03/2027	1,19%
USA TREASURY 0,625% 15/05/2030	1,07%
<b>TOTAL</b>	<b>21,20%</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.