

martes, 10 de septiembre de 2024

Emisiones Vigentes										
Título	Valor Nominal*	Cupón	Precio Limpio	Duración	Tasa 10-sep	Tasa 9-sep	Var.Pb			
4-dic-24	TCO364041224	3,037,500	0.00	98.017	0.23	8.873	VAL	9.021	VAL	-14.8
4-mar-25	TCO364040325	4,750,000	0.00	96.119	0.48	8.555	VAL	8.733	VAL	-17.8
3-jun-25	TCO364030625	6,060,000	0.00	94.109	0.73	8.687	SEN	8.800	SEN	-11.3
2-sep-25	TCO364020925	450,000	0.00	92.277	0.98	8.540	VAL	8.733	VAL	-19.3
26-nov-25	TFIT08261125	8,608,510	6.25	99.307	1.15	6.834	SEN	6.801	SEN	3.3
26-ago-26	TFIT15260826	30,642,949	7.50	98.835	1.89	8.160	SEN	8.200	SEN	-4.0
3-nov-27	TFIT08031127	20,143,991	5.75	92.087	2.81	8.720	SEN	8.763	SEN	-4.3
28-abr-28	TFIT16280428	37,739,563	6.00	91.209	3.28	8.920	SEN	8.930	SEN	-1.0
18-sep-30	TFIT16180930	23,026,093	7.75	93.145	4.62	9.285	SEN	9.261	SEN	2.4
26-mar-31	TFVT10260331	3,229,168	7.00	88.883	5.22	9.330	VAL	9.489	VAL	-15.9
26-mar-31	TFIT10260331	30,494,344	7.00	88.315	5.21	9.460	SEN	9.460	SEN	-0.7
30-jun-32	TFIT16300632	27,972,627	7.00	85.822	6.05	9.660	SEN	9.617	SEN	4.3
9-feb-33	TFIT11090233	27,840,850	13.25	119.277	5.46	9.760	SEN	9.778	SEN	-1.8
18-oct-34	TFIT16181034	28,369,603	7.25	83.347	6.71	9.930	SEN	9.912	SEN	1.8
9-jul-36	TFIT16090736	17,508,585	6.25	73.275	8.01	10.243	SEN	10.248	SEN	-0.5
28-may-42	TFIT21280542	50,337,061	9.25	89.020	8.65	10.640	SEN	10.622	SEN	1.8
25-jul-46	TFIT23250746	11,230,732	11.50	103.964	8.89	11.006	SEN	11.000	SEN	0.6
26-oct-50	TFIT31261050	36,181,510	7.25	69.679	9.29	10.747	SEN	10.710	SEN	3.7
Total Tasa Fija en Pesos		367,623,086						Promedio		-4.1

Título	Valor Nominal*	Cupón	Precio Limpio	Duración	Tasa 10-sep	Tasa 9-sep	Var.Pb			
7-may-25	TUVT11070525	12,446,689	3.500	101.121	0.65	1.752	SEN	1.637	SEN	11.5
17-mar-27	TUVT11170327	24,995,674	3.300	96.844	2.42	4.650	SEN	4.650	SEN	0.0
18-abr-29	TUVT10180429	27,148,050	2.250	89.141	4.37	4.942	SEN	4.922	SEN	2.0
25-mar-33	TUVT20250333	16,602,303	3.000	86.799	7.47	4.929	SEN	4.928	SEN	0.1
4-abr-35	TUVT20040435	36,157,476	4.750	98.435	8.36	4.940	SEN	4.940	SEN	0.0
25-feb-37	TUVT18250237	41,152,494	3.750	88.513	9.79	5.008	SEN	5.005	SEN	0.3
16-jun-49	TUVT32160649	32,276,377	3.750	85.603	15.67	4.749	SEN	4.795	SEN	-4.6
Total Tasa Fija en UVR		190,779,064						Promedio		1.3

*Saldo emisiones vigentes con corte al 06-septiembre-2024

*Cifras en millones de pesos. Fuente: SEN, MEC, Bloomberg, Subasta

VAL: Corresponde a la tasa de valoración vigente para el día de hoy publicada en la página de PRECIA. SUB*es a la tasa de

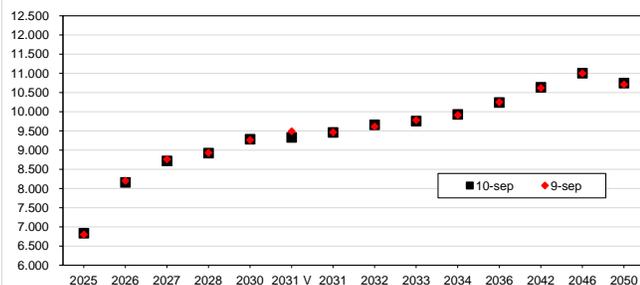
Volumen Negociado SEN*

Rueda CONH	4,059,166,300,673
Rueda Simultánea	8,731,536,347,138
Total	12,790,702,647,811

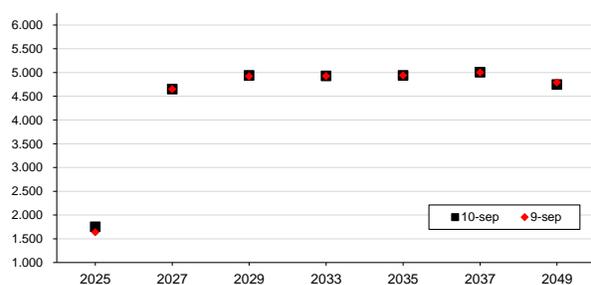
*Cifras en pesos

En el día de hoy los TES COP se valoraron en promedio 0.74 pbs, en donde la parte corta de la curva contribuyó con una desvalorización promedio de 3.30 pbs. Los TES UVR presentaron una desvalorización promedio de 1.33 pbs. El volumen total de negociación en el SEN, en la Ruedas Simultánea y CONH fue de \$12.790,70 mil millones. Donde la parte corta, media y larga de la curva de los TES COP representaron 4.07%, 20.58% y 75.35% respectivamente. Por otro lado, los títulos UVR representaron 22.13% del total transado.

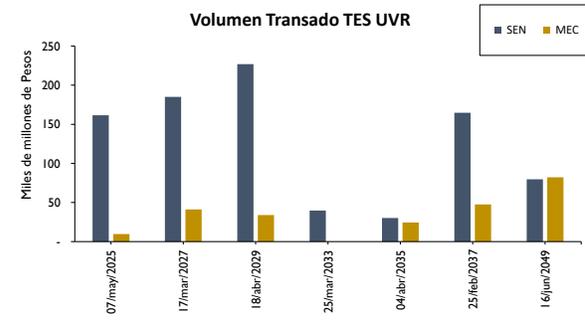
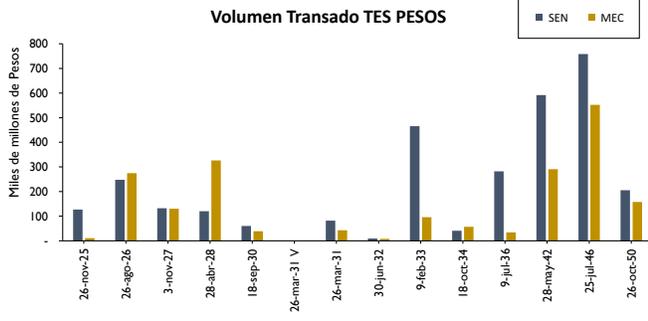
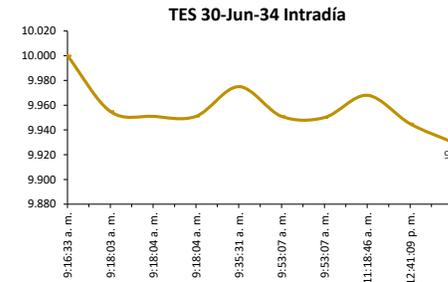
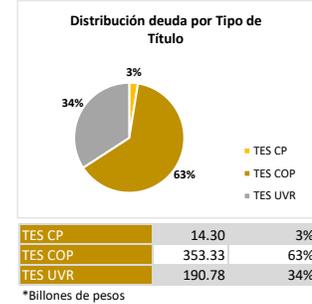
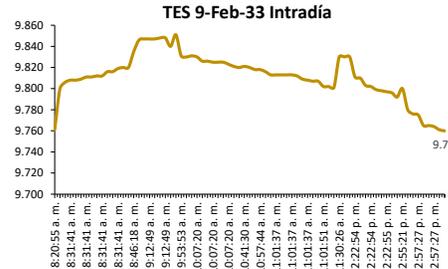
Curva de rendimientos TES PESOS



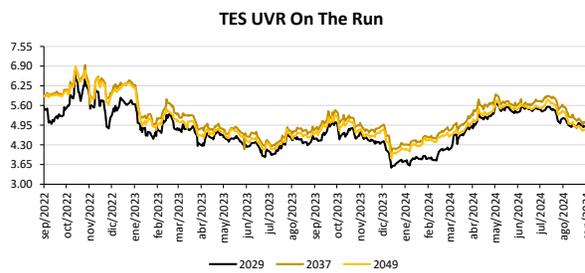
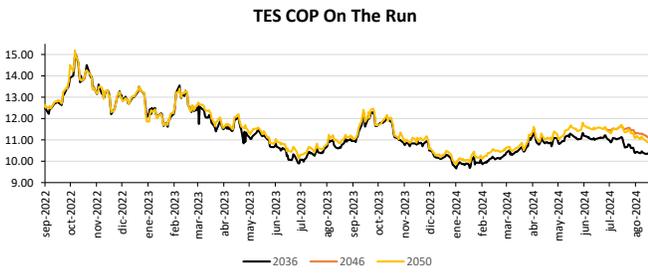
Curva de rendimientos TES UVR



TERMINOS Y CONDICIONES PARA EL USO DE LA INFORMACIÓN CONTENIDA EN ESTE INFORME: La Dirección General de Crédito público y del Tesoro Nacional, por intermedio de la Subdirección de Financiamiento Interno de la Nación, distribuye informes públicos y periódicos donde se incluyen datos relacionados con el mercado secundario de los títulos de deuda pública interna de la República de Colombia, tales como tasas, montos y rendimientos. Dichos documentos contienen información general y por lo tanto, no puede considerarse que mediante uno o varios de ellos se realice una promoción comercial, invitación, asesoría, oferta garantía u obligación de la República de Colombia o del Ministerio de Hacienda y Crédito Público, para vender, comprar, mantener títulos de deuda pública interna, o celebrar operaciones con derivados, ofertas, promesas o cualquier tipo de contrato u operación financiera relacionada con los mismos. En consecuencia, la Nación (Ministerio de Hacienda y Crédito Público) no asume ningún tipo de responsabilidad por las consecuencias derivadas de las acciones u omisiones que se hayan fundamentado en estos informes. Los títulos de deuda interna sobre los cuales versan estos informes fueron emitidos y colocados en el mercado nacional de capitales, por lo cual a su circulación y pago se aplicarán las normas correspondientes a la jurisdicción nacional; nada en este informe puede entenderse como una modificación a los contratos, anexos y demás documentos suscritos en ejecución o desarrollo de operaciones de crédito público, asimiladas o conexas, o como un concepto sobre la posibilidad de realizar transacciones relacionadas con estos títulos en Colombia. Las citas, transcripciones o cualquier tipo de referencia que se haga a todo o parte de estos informes, deberá señalar expresamente la aplicación de estos términos y condiciones.



* Compraventas por negociación y registro



TERMINOS Y CONDICIONES PARA EL USO DE LA INFORMACIÓN CONTENIDA EN ESTE INFORME: La Dirección General de Crédito público y del Tesoro Nacional, por intermedio de la Subdirección de Financiamiento Interno de la Nación, distribuye informes públicos y periódicos donde se incluyen datos relacionados con el mercado secundario de los títulos de deuda pública interna de la República de Colombia, tales como tasas, montos y rendimientos. Dichos documentos contienen información general y por lo tanto, no puede considerarse que mediante uno o varios de ellos se realice una promoción comercial, invitación, asesoría, oferta garantía u obligación de la República de Colombia o del Ministerio de Hacienda y Crédito Público, para vender, comprar, mantener títulos de deuda pública interna, o celebrar operaciones con derivados, ofertas, promesas o cualquier tipo de contrato u operación financiera relacionada con los mismos. En consecuencia, la Nación (Ministerio de Hacienda y Crédito Público) no asume ningún tipo de responsabilidad por las consecuencias derivadas de las acciones u omisiones que se hayan fundamentado en estos informes. Los títulos de deuda interna sobre los cuales versan estos informes fueron emitidos y colocados en el mercado nacional de capitales, por lo cual a su circulación y pago se aplicarán las normas correspondientes a la jurisdicción nacional; nada en este informe puede entenderse como una modificación a los contratos, anexos y demás documentos suscritos en ejecución o desarrollo de operaciones de crédito público, asimiladas o conexas, o como un concepto sobre la posibilidad de realizar transacciones relacionadas con estos títulos en Colombia. Las citas, transcripciones o cualquier tipo de referencia que se haga a todo o parte de estos informes, deberá señalar expresamente la aplicación de éstos términos y condiciones.