

martes, 12 de diciembre de 2023

Emisiones Vigentes										
Título	Valor Nominal*	Cupón	Precio Limpio	Duración	Tasa 12-dic		Tasa 11-dic		Var.Pb	
5-mar-24	TCO363050324	3.017.500	0,00	97,519	0,23	11,535	VAL	11,603	VAL	-6,8
5-jun-24	TCO364050624	2.442.000	0,00	94,898	0,48	11,472	VAL	11,427	VAL	4,5
4-sep-24	TCO364040924	2.640.000	0,00	92,355	0,73	11,485	VAL	11,397	VAL	8,8
4-dic-24	TCO364041224	225.000	0,00	89,951	0,98	11,402	VAL	11,487	VAL	-8,5
24-jul-24	TFIT16240724	11.205.077	10,00	99,768	0,61	10,207	VAL	10,201	SEN	0,6
26-nov-25	TFIT08261125	17.777.434	6,25	93,814	1,90	9,900	SEN	9,897	SEN	0,3
26-ago-26	TFIT15260826	30.621.994	7,50	94,404	2,49	9,951	SEN	9,956	SEN	-0,5
3-nov-27	TFIT08031127	20.130.204	5,75	86,690	3,55	10,050	SEN	10,070	SEN	-2,0
28-abr-28	TFIT16280428	33.744.475	6,00	86,176	3,79	10,080	SEN	10,080	SEN	0,0
18-sep-30	TFIT16180930	22.337.127	7,75	88,034	5,32	10,320	SEN	10,290	SEN	3,0
26-mar-31	TFVT10260331	2.142.224	7,00	82,826	5,48	10,511	SEN	10,470	SEN	4,1
26-mar-31	TFIT10260331	30.256.639	7,00	82,906	5,48	10,470	SEN	10,450	SEN	2,0
30-jun-32	TFIT16300632	27.953.498	7,00	79,779	6,24	10,700	SEN	10,702	SEN	-0,2
9-feb-33	TFIT11090233	22.396.402	13,25	113,405	5,49	10,860	SEN	10,889	SEN	-2,9
18-oct-34	TFIT16181034	27.735.275	7,25	77,520	7,33	10,880	SEN	10,902	SEN	-2,2
9-jul-36	TFIT16090736	12.051.017	6,25	68,638	7,98	10,935	SEN	10,947	SEN	-1,2
28-may-42	TFIT21280542	32.651.717	9,25	84,838	8,35	11,192	SEN	11,289	SEN	-9,7
26-oct-50	TFIT31261050	25.894.882	7,25	67,190	9,83	11,090	SEN	11,169	SEN	-7,9
Total Tasa Fija en Pesos		325.222.464							Promedio	-1,0

Título	Valor Nominal*	Cupón	Precio Limpio	Duración	Tasa 12-dic		Tasa 11-dic		Var.Pb	
7-may-25	TUVT11070525	18.949.080	3,500	99,416	1,37	3,940	SEN	3,940	SEN	0,0
17-mar-27	TUVT11170327	23.738.478	3,300	96,944	3,07	4,300	SEN	4,360	SEN	-6,0
18-abr-29	TUVT10180429	18.516.812	2,250	89,932	5,00	4,351	SEN	4,419	SEN	-6,8
25-mar-33	TUVT20250333	15.767.264	3,000	87,073	7,96	4,720	SEN	4,752	SEN	-3,2
4-abr-35	TUVT20040435	34.093.487	4,750	98,766	8,71	4,875	SEN	4,915	SEN	-4,0
25-feb-37	TUVT18250237	34.581.919	3,750	88,546	10,14	4,890	SEN	4,974	SEN	-8,4
16-jun-49	TUVT32160649	24.432.533	3,750	84,538	15,74	4,750	SEN	4,816	SEN	-6,6
Total Tasa Fija en UVR		170.079.574							Promedio	-5,0

*Saldo emisiones vigentes con corte al 07-Diciembre-2023

*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 corte de la subasta hecha el día de hoy

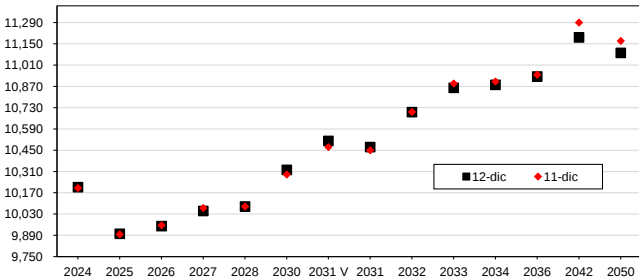
Volumen Negociado SEN*

Rueda CONH	2.773.265.531.439
Rueda Simultáneas	9.534.405.365.663
Total	12.307.670.897.102

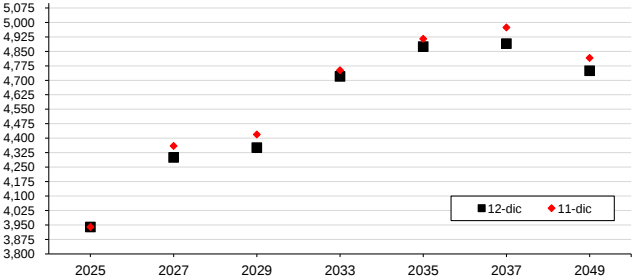
*Cifras en pesos

En el día de hoy los TES COP se valorizaron en promedio 1,19 pbs, en donde la parte corta de la curva contribuyó con una desvalorización promedio de 0,45 pbs. Los TES UVR presentaron una valorización promedio de 5 pbs. El volumen total de negociación en el SEN, en la Ruedas Simultánea y CONH fue de \$12.307,67 mil millones. Donde la parte corta, media y larga de la curva de los TES COP representaron 0,04%, 18,76% y 81,19% respectivamente. Por otro lado, los títulos UVR representaron 20,80% del total transado.

Curva de rendimientos TES PESOS

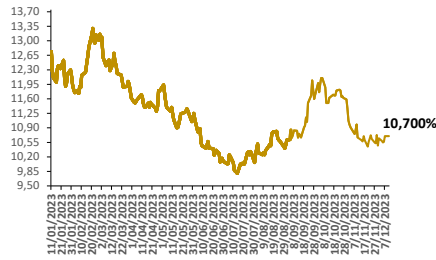


Curva de rendimientos TES UVR

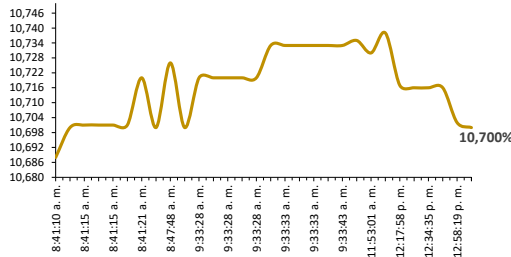


TERMINOS Y CONDICIONES PARA EL USO DE LA INFORMACIÓN CONTENIDA EN ESTE INFORME: La Dirección General de Crédito Público y del Tesoro Nacional, por intermedio de la Subdirección de Financiamiento Interno de la Nación, distribuye informes públicos y periódicos donde se incluyen datos relacionados con el 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 fundamentando 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 éste informe puede entenderse como una modificación a los contratos, anexos y demás documentos suscritos en ejecución de 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.

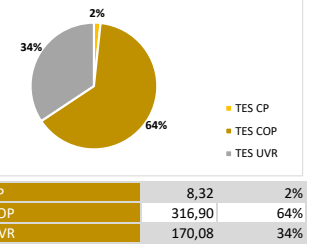
TES 30-Jun-32 Histórico*



TES 9-Feb-33 Intradiá

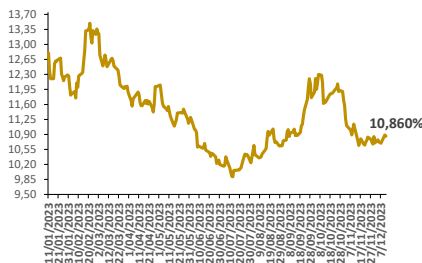


Distribución deuda por Tipo de Título

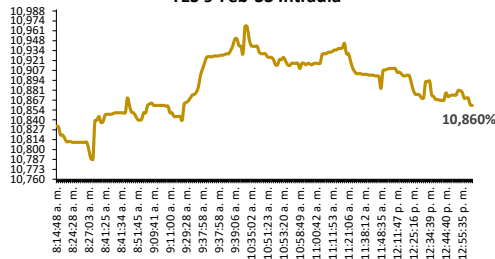


*Billones de pesos

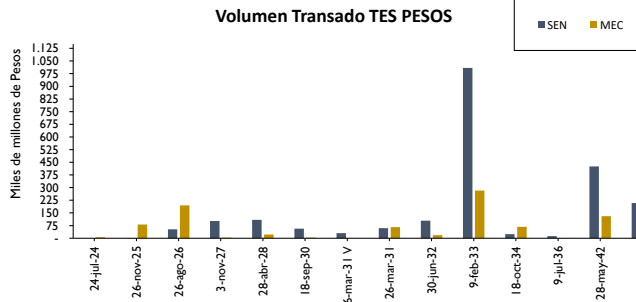
TES 9-Feb-33 Histórico*



TES 9-Feb-33 Intradiá

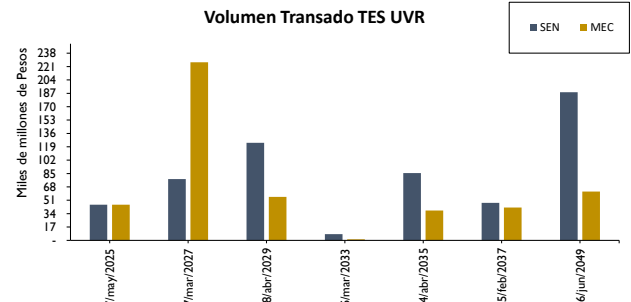


Volumen Transado TES PESOS



* Compraventas por negociación y registro

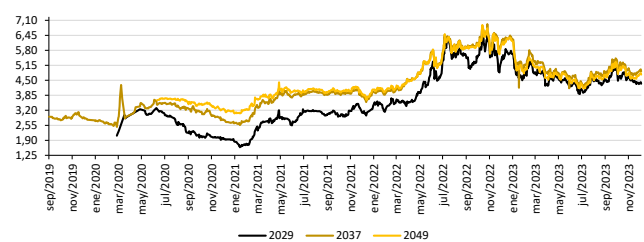
Volumen Transado TES UVR



TES COP On The Run



TES UVR On The Run



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 fundamentando 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 éste informe puede entenderse como una modificación a los contratos, anexos y demás documentos suscritos en ejecución de 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.