



jueves, 30 de diciembre de 2021

Emisiones Vigentes										
Título	Valor Nominal*	Cupón	Precio Limpio	Duración	Tasa 30-dic	Tasa 29-dic	Var.Pb			
08-mar-22	TCO364080322	3,873,340	0.00	99.369	0.19	3.405	VAL	3.459	VAL	-5.4
07-jun-22	TCO364070622	4,213,260	0.00	98.478	0.44	3.561	VAL	4.522	VAL	-96.1
06-sep-22	TCO364060922	3,390,500	0.00	96.776	0.68	4.900	SEN	4.665	VAL	23.5
06-dic-22	TCO364061222	575,000	0.00	95.236	0.93	5.348	VAL	5.287	VAL	6.1
04-may-22	TFIT10040522	9,636,569	7.00	101.230	0.34	3.254	SEN	3.299	SEN	-4.5
24-jul-24	TFIT16240724	24,563,554	10.00	107.151	2.31	6.830	SEN	6.820	SEN	1.0
26-nov-25	TFIT08261125	19,952,832	6.25	96.202	3.56	7.392	SEN	7.401	SEN	-0.2
26-ago-26	TFIT15260826	28,778,994	7.50	99.406	4.00	7.640	SEN	7.670	SEN	-3.0
03-nov-27	TFIT08031127	20,130,204	5.75	90.551	5.04	7.819	VAL	7.840	SEN	-2.1
28-abr-28	TFIT16280428	31,116,142	6.00	90.498	5.17	7.958	VAL	7.945	SEN	1.3
18-sep-30	TFIT16180930	22,037,127	7.75	97.807	6.49	8.100	VAL	8.136	SEN	-3.6
26-mar-31	TFVT10260331	1,497,329	7.00	92.967	6.64	8.103	VAL	8.126	SEN	-2.3
26-mar-31	TFIT10260331	14,172,444	7.00	92.558	6.64	8.170	VAL	8.204	SEN	-3.4
30-jun-32	TFIT16300632	27,953,498	7.00	91.369	7.37	8.250	VAL	8.250	SEN	0.0
18-oct-34	TFIT16181034	27,505,275	7.25	92.010	8.45	8.280	VAL	8.320	SEN	-4.0
09-jul-36	TFIT16090736	12,051,017	6.25	82.727	9.15	8.337	VAL	8.357	SEN	-2.0
26-oct-50	TFIT31261050	15,286,521	7.25	86.368	11.64	8.530	SEN	8.565	SEN	-3.5
Total Tasa Fija en Pesos		266,733,606						Promedio		-5.8

Título	Valor Nominal*	Cupón	Precio Limpio	Duración	Tasa 30-dic	Tasa 29-dic	Var.Pb			
23-feb-23	TUVT17230223	29,578,599	4.750	104.515	1.11	0.790	SEN	0.800	SEN	-1.0
07-may-25	TUVT11070525	11,064,786	3.500	104.285	3.16	2.159	VAL	2.146	VAL	1.3
17-mar-27	TUVT11170327	19,184,462	3.300	102.301	4.76	2.818	VAL	2.745	VAL	7.3
18-abr-29	TUVT10180429	8,331,751	2.250	94.039	6.68	3.176	VAL	3.182	SEN	-0.6
25-mar-33	TUVT20250333	12,739,572	3.000	94.744	9.42	3.575	VAL	3.580	SEN	-0.5
04-abr-35	TUVT20040435	19,728,973	4.750	110.108	9.99	3.765	SEN	3.658	VAL	10.7
25-feb-37	TUVT18250237	18,132,775	3.750	99.082	11.45	3.830	SEN	3.695	VAL	13.5
16-jun-49	TUVT32160649	12,056,396	3.750	97.317	17.11	3.910	SEN	3.813	VAL	9.7
Total Tasa Fija en UVR		130,817,314						Promedio		5.1

*Saldo emisiones vigentes con corte al 24-diciembre-2021

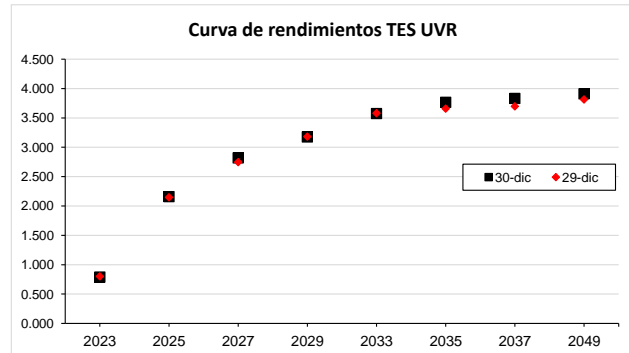
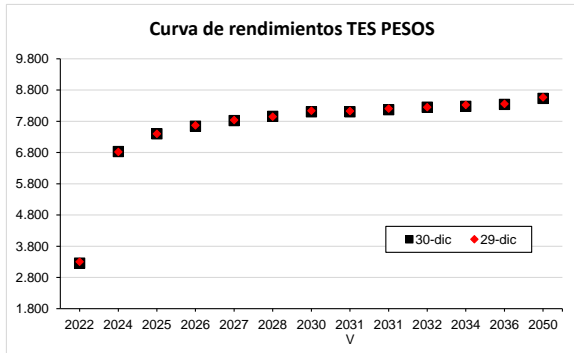
*Cifras en millones de pesos. Fuente: SEN, MEC, Bloomberg, Subasta

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	204,270,429,026
Rueda Simultáneas	466,902,483,309
Total	671,172,912,335

*Cifras en pesos

En el día de hoy los TES COP se valorizaron en promedio 2.02 pbs, en donde la parte corta de la curva contribuyó con una valorización promedio de 1.75 pbs. Los TES UVR presentaron una desvalorización promedio de 5.05 pbs. El volumen total de negociación en el SEN, en la Ruedas Simultánea y CONH fue de \$671.18 mil millones. Donde la parte corta, media y larga de la curva de los TES COP representaron 1.94%, 78.02% y 20.05% respectivamente. Por otro lado, los títulos UVR representaron 38.93% del total transado.



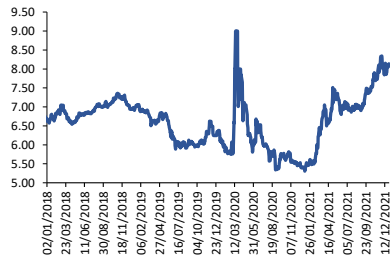
TERMINOS Y CONDICIONES PARA EL USO DE LA INFORMACIÓN CONTENIDA EN ESTE INFORME: La Dirección General de Crédito Público y del Tesoro Nacional, por intermedio de la Subdirección de Financiamiento Interno de la Nación, distribuye informes públicos y periódicos donde se incluyen datos relacionados con el 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 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.

INFORME DIARIO DE DEUDA PÚBLICA

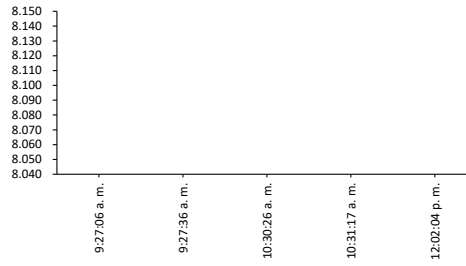
Subdirección de Financiamiento Interno de la Nación
 Dirección General de Crédito Público y Tesoro Nacional
 Ministerio de Hacienda y Crédito Público



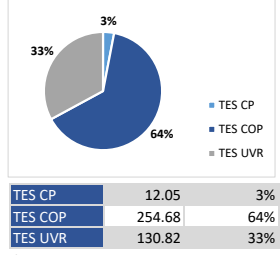
TES 18-Sep-30 Histórico*



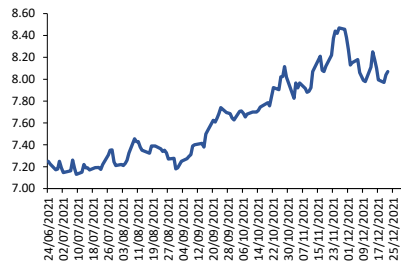
TES 18-Sep-30 Intradía



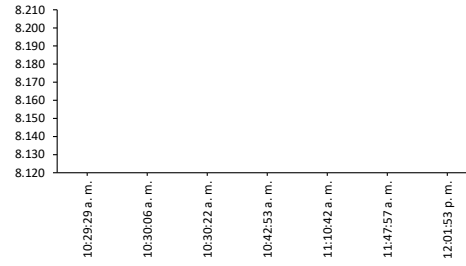
Distribución deuda por Tipo de Título



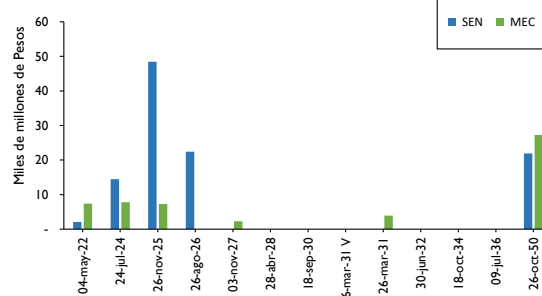
TES 26-Mar-31 Histórico*



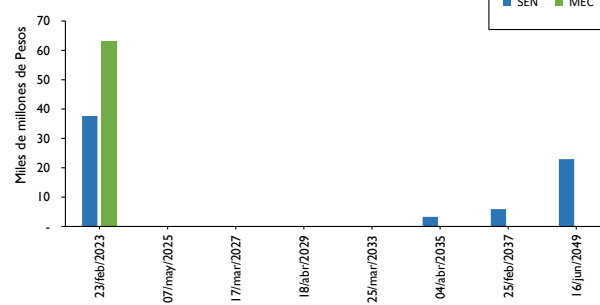
TES 26-Mar-31 Intradía



Volumen Transado TES PESOS

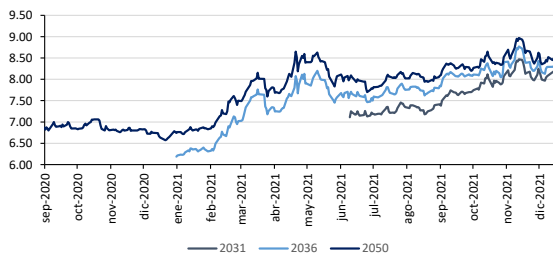


Volumen Transado TES UVR

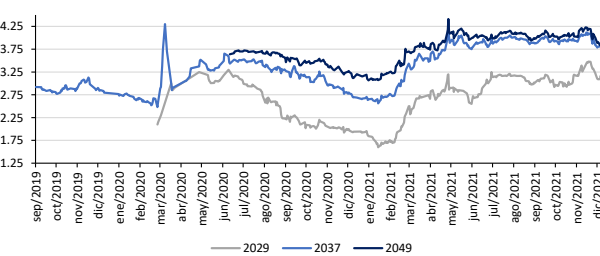


* Compraventas por negociación y registro

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 éstos 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 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.