

Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B



Fecha de Corte : 30-abr-2022
TRM 3,966.27
UVR 302.6269

Indicadores y Composición General

Condiciones Financieras del Portafolio			
Concepto	(Millones de Pesos)		TOTAL
	Denominación TES PESOS	TES UVR	
Valor Nominal	279,907,214	140,444,211	420,351,425
Valor de Mercado	249,100,080	136,771,838	385,871,918
Cupón Promedio	6.868	12.699	8.817
Descuento Promedio	9.817	12.380	10.674
Vida Media	8.417	9.688	8.842
Duración	5.262	7.335	5.955
Duración Modificada	4.773	7.033	5.528
Participación	66.59%	33.41%	100.00%

Análisis Comparativo

Títulos de Tesorería TES Evolución del Perfil de Deuda (Millones de Pesos)						
Comportamiento Anual y Acumulado						
TOTAL GENERAL	abr-21	abr-22	Variación Anual	dic-21	Var. Acum	Var. Acum %
Valor Nominal	361,332,208	420,351,425	16.33%	397,878,200	22,473,225	5.65%
Valor de Mercado	384,224,339	385,871,918	0.43%	396,934,555	(11,062,638)	-2.79%
Cupón Promedio	6.423	8.817	37.26%	7.644	117 pb	15.33%
Descuento Promedio	5.154	10.674	107.10%	7.771	290 pb	37.34%
Vida Media	8.254	8.842	7.12%	8.647	0.195	2.25%
Duración	5.969	5.955	-0.24%	6.119 -	0.165	-2.69%
Duración Modificada	5.671	5.528	-2.53%	5.761 -	0.233	-4.04%

Variación Anual				Variación Anual			
TES PESOS	abr-21	abr-22	Variación Anual	TES UVR	abr-21	abr-22	Variación Anual
Valor Nominal	249,102,336	279,907,214	12.37%	Valor Nominal	112,229,871	140,444,211	25.14%
Valor de Mercado	265,620,737	249,100,080	-6.22%	Valor de Mercado	118,603,601	136,771,838	15.32%
Cupón Promedio	6.841	6.868	0.40%	Cupón Promedio	5.496	12.699	131.06%
Descuento Promedio	5.696	9.817	72.35%	Descuento Promedio	3.950	12.380	213.40%
Vida Media	7.741	8.417	8.73%	Vida Media	9.393	9.688	3.14%
Duración	5.363	5.262	-1.87%	Duración	7.316	7.335	0.25%
Duración Modificada	5.032	4.773	-5.15%	Duración Modificada	7.091	7.033	-0.82%

Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B



**El emprendimiento
es de todos**

Minhacienda

Portafolio por Tipo de Tasa y Denominación

Concepto	Portafolio de TES por Tipo de Tasa (Millones de Pesos)				
	TES PESOS			TES UVR	TOTAL
	Descuento	Fija	Total COP		
Valor Nominal	13,050,829	266,856,385	279,907,214	140,444,211	420,351,425
Valor de Mercado	12,659,654	236,440,426	249,100,080	136,771,838	385,871,918
Cupón Promedio	-	7.204	6.868	12.699	8.817
Descuento Promedio	7.045	9.953	9.817	12.380	10.674
Vida Media	0.418	8.808	8.417	9.688	8.842
Duración	0.418	5.499	5.262	7.335	5.955
Duración Modificada	0.388	4.987	4.773	7.033	5.528

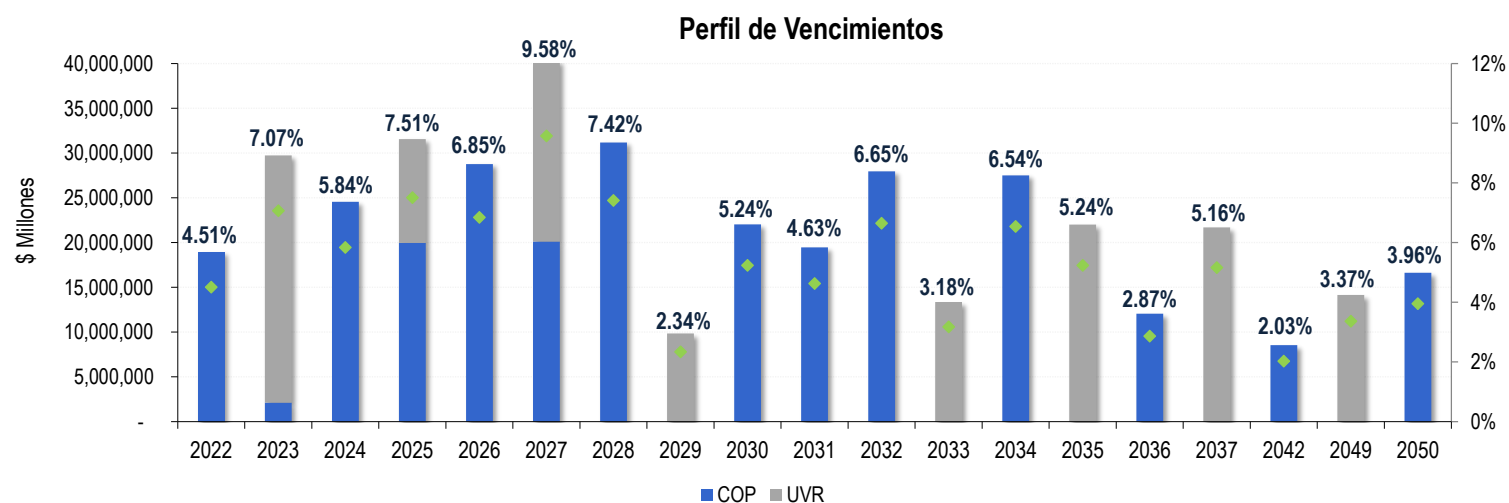
Portafolio por Tipo de Tasa y Denominación en Moneda Original

Concepto	Portafolio de TES por Tipo de Tasa			
	TES PESOS			TES UVR
	Descuento	Fija	Total COP	
Valor Nominal	13,050,829	266,856,385	279,907,214	464,084
Valor de Mercado	12,659,654	236,440,426	249,100,080	451,949
Cupón Promedio	-	7.204	6.868	3.841
Descuento Promedio	7.045	9.953	9.817	3.548
Vida Media	0.418	8.808	8.417	9.688
Duración	0.418	5.499	5.262	7.335
Duración Modificada	0.388	4.987	4.773	7.033

Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B

Portafolio por Año de Vencimiento

Año Vencimiento	Portafolio por Año de Vencimiento (Millones de Pesos)			TES UVR	TOTAL	Participación
	TES PESOS					
	Descuento	Fija	Total COP			
2022	10,917,759	8,049,504	18,967,263	-	18,967,263	4.51%
2023	2,133,070	-	2,133,070	27,599,572	29,732,642	7.07%
2024	-	24,563,554	24,563,554	-	24,563,554	5.84%
2025	-	19,952,832	19,952,832	11,614,878	31,567,710	7.51%
2026	-	28,778,994	28,778,994	-	28,778,994	6.85%
2027	-	20,130,204	20,130,204	20,138,228	40,268,432	9.58%
2028	-	31,180,975	31,180,975	-	31,180,975	7.42%
2029	-	-	-	9,849,160	9,849,160	2.34%
2030	-	22,037,127	22,037,127	-	22,037,127	5.24%
2031	-	19,473,409	19,473,409	-	19,473,409	4.63%
2032	-	27,953,498	27,953,498	-	27,953,498	6.65%
2033	-	-	-	13,372,927	13,372,927	3.18%
2034	-	27,505,275	27,505,275	-	27,505,275	6.54%
2035	-	-	-	22,015,601	22,015,601	5.24%
2036	-	12,051,017	12,051,017	-	12,051,017	2.87%
2037	-	-	-	21,697,234	21,697,234	5.16%
2042	-	8,544,746	8,544,746	-	8,544,746	2.03%
2049	-	-	-	14,156,613	14,156,613	3.37%
2050	-	16,635,249	16,635,249	-	16,635,249	3.96%
TOTAL	13.050.829	266.856.385	279.907.214	140.444.211	420.351.425	100%

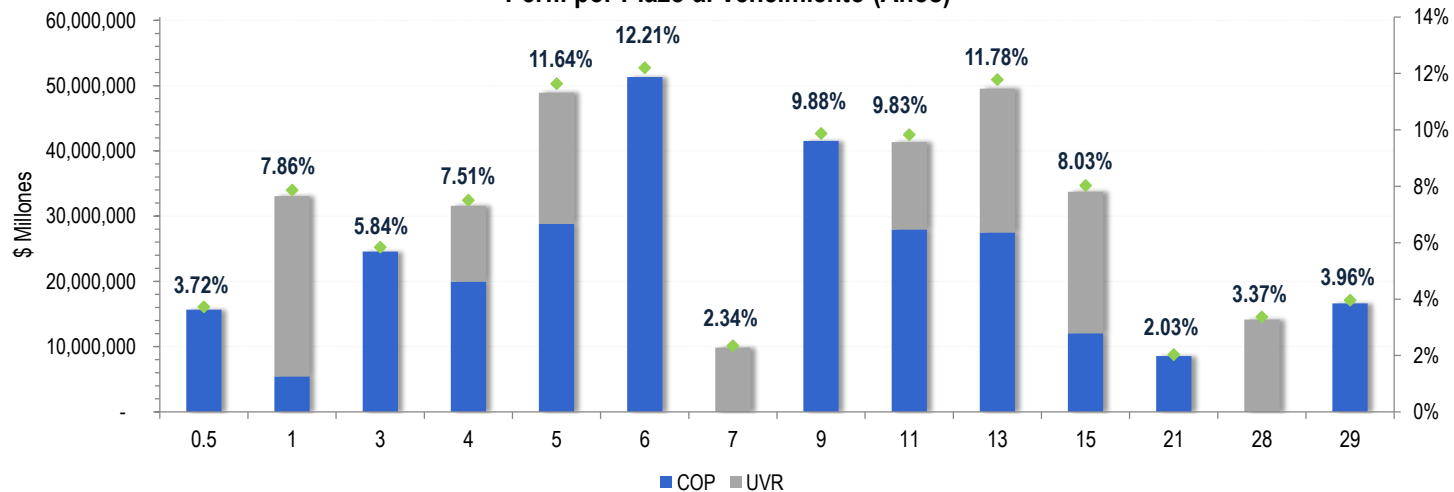


Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B

Portafolio por Plazo al Vencimiento

Plazo al Vencimiento (Años)	Portafolio por Plazo al Vencimiento (Millones de Pesos)					
	TES PESOS			TES UVR	TOTAL	Participacion
	Descuento	Fija	Total COP			
0.5	7,603,759	8,049,504	15,653,264	-	15,653,264	3.72%
1	5,447,070	-	5,447,070	27,599,572	33,046,642	7.86%
3	-	24,563,554	24,563,554	-	24,563,554	5.84%
4	-	19,952,832	19,952,832	11,614,878	31,567,710	7.51%
5	-	28,778,994	28,778,994	20,138,228	48,917,222	11.64%
6	-	51,311,179	51,311,179	-	51,311,179	12.21%
7	-	-	-	9,849,160	9,849,160	2.34%
9	-	41,510,536	41,510,536	-	41,510,536	9.88%
11	-	27,953,498	27,953,498	13,372,927	41,326,424	9.83%
13	-	27,505,275	27,505,275	22,015,601	49,520,876	11.78%
15	-	12,051,017	12,051,017	21,697,234	33,748,251	8.03%
21	-	8,544,746	8,544,746	-	8,544,746	2.03%
28	-	-	-	14,156,613	14,156,613	3.37%
29	-	16,635,249	16,635,249	-	16,635,249	3.96%
TOTAL	13,050,829	266,856,385	279,907,214	140,444,211	420,351,425	100%

Perfil por Plazo al Vencimiento (Años)

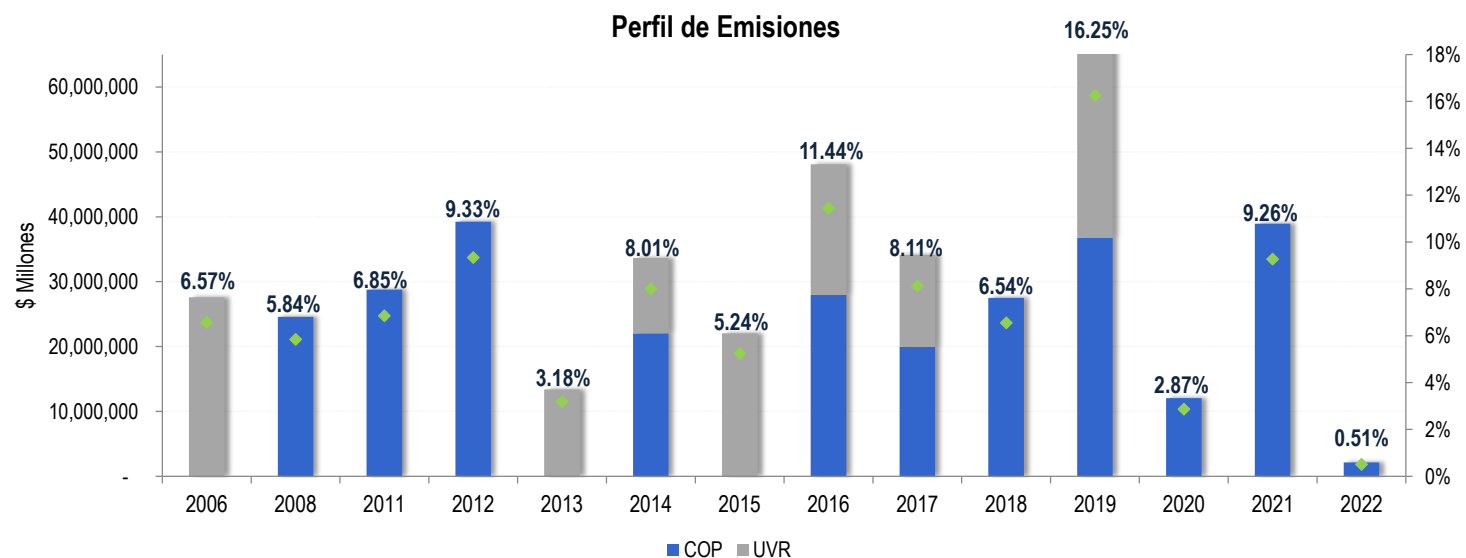


Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B



Portafolio por Año de Emisión

Año Emisión	TES PESOS (Millones de Pesos)			TES UVR	TOTAL	Participacion
	Descuento	Fija	Total COP			
2006	-	-	-	27,599,572	27,599,572	6.57%
2008	-	24,563,554	24,563,554	-	24,563,554	5.84%
2011	-	28,778,994	28,778,994	-	28,778,994	6.85%
2012	-	39,230,479	39,230,479	-	39,230,479	9.33%
2013	-	-	-	13,372,927	13,372,927	3.18%
2014	-	22,037,127	22,037,127	11,614,878	33,652,005	8.01%
2015	-	-	-	22,015,601	22,015,601	5.24%
2016	-	27,953,498	27,953,498	20,138,228	48,091,725	11.44%
2017	-	19,952,832	19,952,832	14,156,613	34,109,445	8.11%
2018	-	27,505,275	27,505,275	-	27,505,275	6.54%
2019	-	36,765,454	36,765,454	31,546,393	68,311,847	16.25%
2020	-	12,051,017	12,051,017	-	12,051,017	2.87%
2021	10,917,759	28,018,155	38,935,914	-	38,935,914	9.26%
2022	2,133,070	-	2,133,070	-	2,133,070	0.51%
TOTAL	13,050,829	266,856,385	279,907,214	140,444,211	420,351,425	100%



Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B

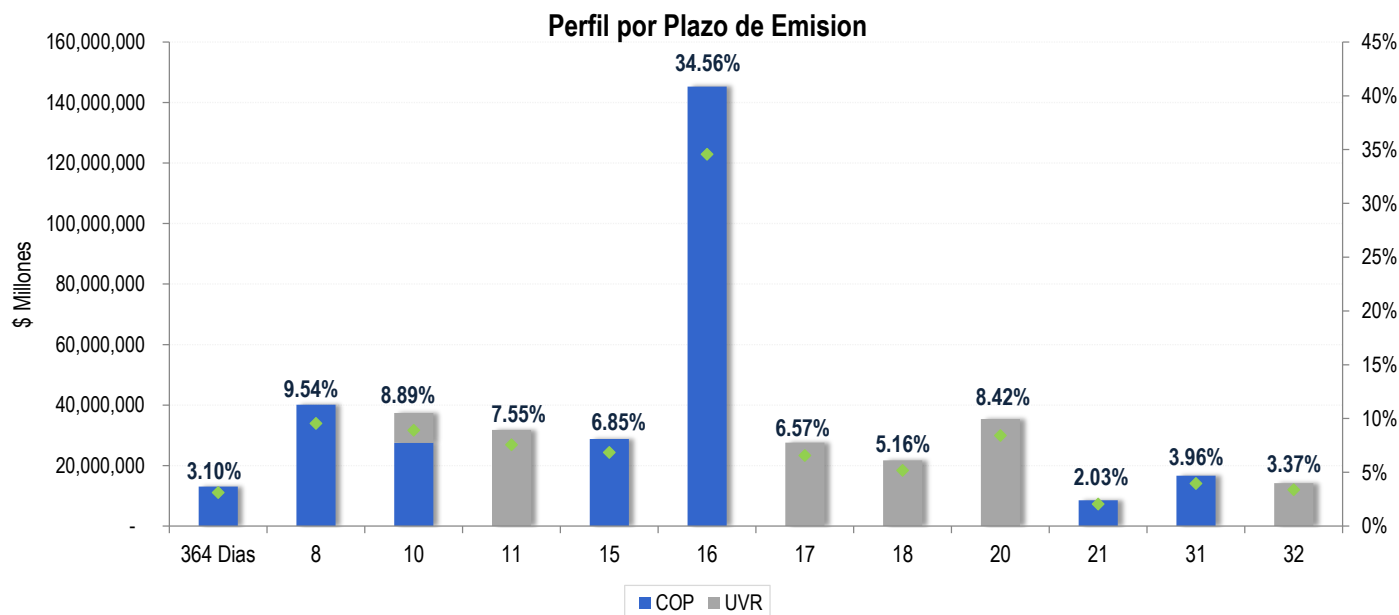


**El emprendimiento
es de todos**

Minhacienda

Portafolio por Plazo de Emisión

Portafolio por Plazo de Emision (Millones de Pesos)						
Plazo de Emisión (Años)	TES PESOS			TES UVR	TOTAL	Participación
	Descuento	Fija	Total COP			
364 Dias	13,050,829	-	13,050,829	-	13,050,829	3.10%
8	-	40,083,036	40,083,036	-	40,083,036	9.54%
10	-	27,522,913	27,522,913	9,849,160	37,372,072	8.89%
11	-	-	-	31,753,105	31,753,105	7.55%
15	-	28,778,994	28,778,994	-	28,778,994	6.85%
16	-	145,291,446	145,291,446	-	145,291,446	34.56%
17	-	-	-	27,599,572	27,599,572	6.57%
18	-	-	-	21,697,234	21,697,234	5.16%
20	-	-	-	35,388,527	35,388,527	8.42%
21	-	8,544,746	8,544,746	-	8,544,746	2.03%
31	-	16,635,249	16,635,249	-	16,635,249	3.96%
32	-	-	-	14,156,613	14,156,613	3.37%
TOTAL	13,050,829	266,856,385	279,907,214	140,444,211	420,351,425	100%



Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B

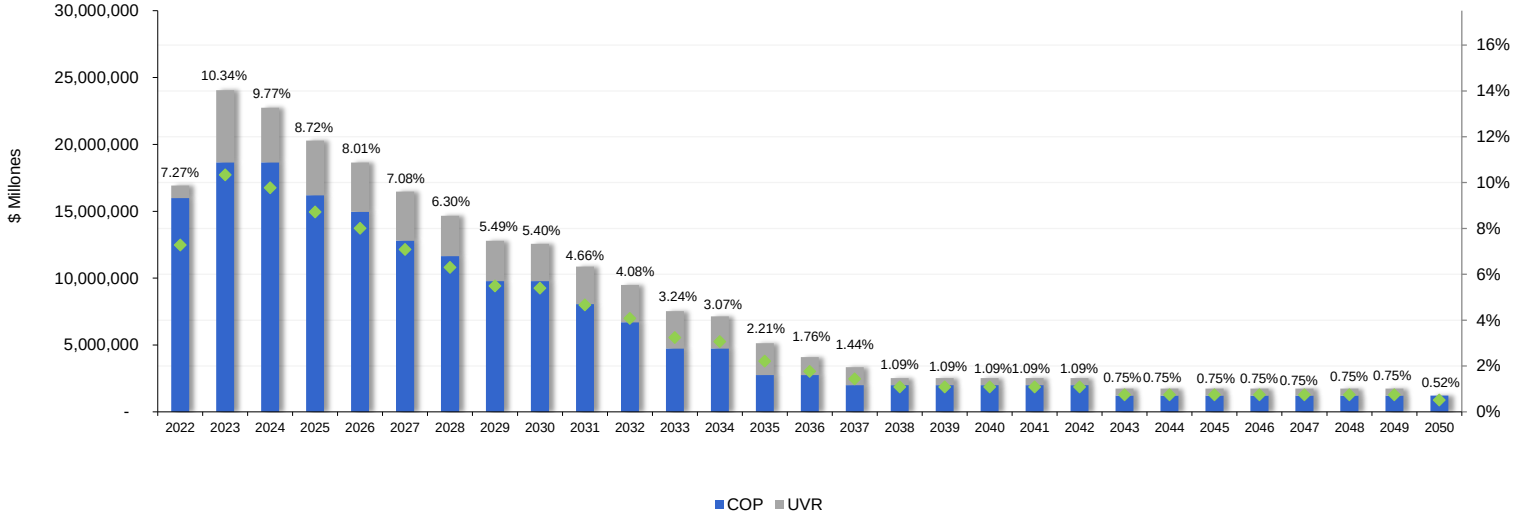


Perfil de Intereses

Año de Pago	Perfil de Intereses (Millones de Pesos)					
	TES PESOS			TES UVR	TOTAL	Participación
	Descuento	Fija	Total COP			
2022	-	15,991,172	15,991,172	937,394	16,928,566	7.27%
2023	-	18,661,704	18,661,704	5,395,116	24,056,820	10.34%
2024	-	18,661,704	18,661,704	4,084,136	22,745,840	9.77%
2025	-	16,205,348	16,205,348	4,084,136	20,289,485	8.72%
2026	-	14,958,296	14,958,296	3,677,616	18,635,912	8.01%
2027	-	12,799,872	12,799,872	3,677,616	16,477,487	7.08%
2028	-	11,642,385	11,642,385	3,013,054	14,655,439	6.30%
2029	-	9,771,526	9,771,526	3,013,054	12,784,581	5.49%
2030	-	9,771,526	9,771,526	2,791,448	12,562,975	5.40%
2031	-	8,063,649	8,063,649	2,791,448	10,855,097	4.66%
2032	-	6,700,510	6,700,510	2,791,448	9,491,959	4.08%
2033	-	4,743,766	4,743,766	2,791,448	7,535,214	3.24%
2034	-	4,743,766	4,743,766	2,390,260	7,134,026	3.07%
2035	-	2,749,633	2,749,633	2,390,260	5,139,893	2.21%
2036	-	2,749,633	2,749,633	1,344,519	4,094,152	1.76%
2037	-	1,996,445	1,996,445	1,344,519	3,340,964	1.44%
2038	-	1,996,445	1,996,445	530,873	2,527,318	1.09%
2039	-	1,996,445	1,996,445	530,873	2,527,318	1.09%
2040	-	1,996,445	1,996,445	530,873	2,527,318	1.09%
2041	-	1,996,445	1,996,445	530,873	2,527,318	1.09%
2042	-	1,996,445	1,996,445	530,873	2,527,318	1.09%
2043	-	1,206,056	1,206,056	530,873	1,736,929	0.75%
2044	-	1,206,056	1,206,056	530,873	1,736,929	0.75%
2045	-	1,206,056	1,206,056	530,873	1,736,929	0.75%
2046	-	1,206,056	1,206,056	530,873	1,736,929	0.75%
2047	-	1,206,056	1,206,056	530,873	1,736,929	0.75%
2048	-	1,206,056	1,206,056	530,873	1,736,929	0.75%
2049	-	1,206,056	1,206,056	530,873	1,736,929	0.75%
2050	-	1,206,056	1,206,056	-	1,206,056	0.52%
TOTAL	-	179,841,603	179,841,603	52,887,950	232,729,552	100%

Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B

Perfil de Intereses



Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B



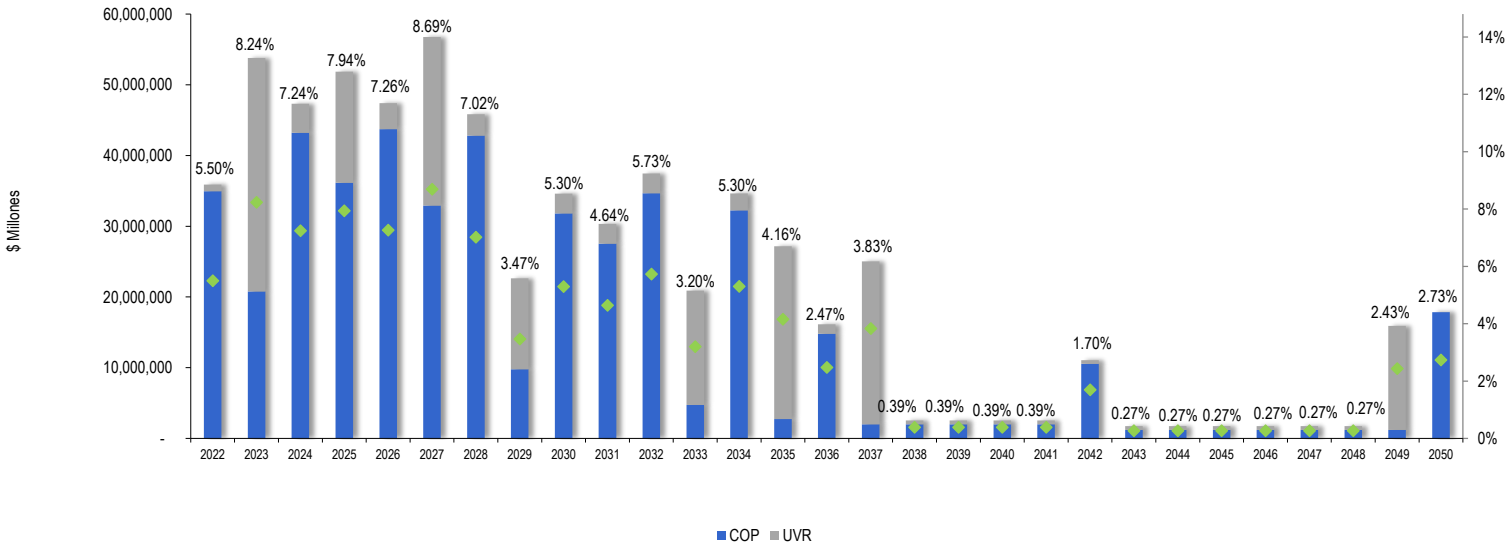
Perfil de Servicio de la Deuda

Año de Pago	Perfil de Servicio de Deuda (Millones de Pesos)					
	TES PESOS			TES UVR	TOTAL	Participación
	Descuento	Fija	Total COP			
2022	10,917,759	24,040,676	34,958,435	937,394	35,895,829	5.50%
2023	2,133,070	18,661,704	20,794,774	32,994,688	53,789,461	8.24%
2024	-	43,225,257	43,225,257	4,084,136	47,309,394	7.24%
2025	-	36,158,180	36,158,180	15,699,014	51,857,194	7.94%
2026	-	43,737,290	43,737,290	3,677,616	47,414,906	7.26%
2027	-	32,930,076	32,930,076	23,815,843	56,745,920	8.69%
2028	-	42,823,360	42,823,360	3,013,054	45,836,414	7.02%
2029	-	9,771,526	9,771,526	12,862,214	22,633,740	3.47%
2030	-	31,808,654	31,808,654	2,791,448	34,600,102	5.30%
2031	-	27,537,058	27,537,058	2,791,448	30,328,506	4.64%
2032	-	34,654,008	34,654,008	2,791,448	37,445,456	5.73%
2033	-	4,743,766	4,743,766	16,164,375	20,908,140	3.20%
2034	-	32,249,041	32,249,041	2,390,260	34,639,301	5.30%
2035	-	2,749,633	2,749,633	24,405,861	27,155,494	4.16%
2036	-	14,800,650	14,800,650	1,344,519	16,145,170	2.47%
2037	-	1,996,445	1,996,445	23,041,753	25,038,197	3.83%
2038	-	1,996,445	1,996,445	530,873	2,527,318	0.39%
2039	-	1,996,445	1,996,445	530,873	2,527,318	0.39%
2040	-	1,996,445	1,996,445	530,873	2,527,318	0.39%
2041	-	1,996,445	1,996,445	530,873	2,527,318	0.39%
2042	-	10,541,191	10,541,191	530,873	11,072,064	1.70%
2043	-	1,206,056	1,206,056	530,873	1,736,929	0.27%
2044	-	1,206,056	1,206,056	530,873	1,736,929	0.27%
2045	-	1,206,056	1,206,056	530,873	1,736,929	0.27%
2046	-	1,206,056	1,206,056	530,873	1,736,929	0.27%
2047	-	1,206,056	1,206,056	530,873	1,736,929	0.27%
2048	-	1,206,056	1,206,056	530,873	1,736,929	0.27%
2049	-	1,206,056	1,206,056	14,687,486	15,893,542	2.43%
2050	-	17,841,305	17,841,305	-	17,841,305	2.73%
TOTAL	13,050,829	446,697,988	459,748,817	193,332,160	653,080,977	100%

Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B



Perfil de Servicio de la Deuda



Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B



Tenedores

Grupo / Tenedores	Saldo por Grupo de Tenedores (Millones de Pesos)			
	TES PESOS	TES UVR	Total	Participación
Fondos de Pensiones y Cesantías	51,242,021	66,422,098	117,664,119	27.99%
Fondos de Capital Extranjero ¹	97,868,617	6,286,711	104,155,328	24.78%
Bancos Comerciales	44,595,563	18,457,068	63,052,631	15.00%
Fiducia Publica	27,972,268	10,703,099	38,675,367	9.20%
Banco de la Republica	26,122,743	4,988,128	31,110,871	7.40%
Compañías de Seguros y Capitalizacion	6,684,625	20,257,907	26,942,532	6.41%
Instituciones Oficiales Especiales ²	13,315,504	4,465,402	17,780,907	4.23%
Carteras Colectivas y Fondos Administrados ³	3,502,289	1,814,854	5,317,143	1.26%
Ministerio de Hacienda y CP	939,235	4,248,265	5,187,500	1.23%
Fondos de Prima Media	1,610,009	1,373,975	2,983,983	0.71%
Corporaciones Financieras	1,838,357	622,430	2,460,787	0.59%
Personas Juridicas	1,248,867	274,038	1,522,905	0.36%
Entidades Publicas	1,046,447	33,712	1,080,159	0.26%
Proveedores de Infraestructura ⁴	449,549	182,034	631,583	0.15%
Comisionistas de Bolsa	436,906	144,574	581,480	0.14%
Entidades sin Animo de Lucro	420,247	33,652	453,899	0.11%
Administradoras de Carteras Colectivas y de Fdos Pensiones y Cesantías ⁵	271,038	107,281	378,319	0.09%
Personas Naturales	216,310	15,545	231,856	0.06%
Otros Fondos ⁶	69,619	10,410	80,029	0.02%
Compañías de Financiamiento Comercial	53,500	3,026	56,526	0.01%
Cooperativas Grado Super. Caracter Finan	3,500	-	3,500	0.00%
	279,907,214	140,444,211	420,351,425	100%

¹ Incluye las Inversiones en TES de los Fondos de Capital Extranjero.

² Incluye las inversiones en TES de las entidades así categorizadas por la Superintendencia Financiera de Colombia.

³ Incluye las inversiones en TES de las Carteras Colectivas administradas por Sociedades Fiduciarias, Sociedades Comisionistas de Bolsa y Sociedades Administradoras de Inversión.

⁴ Incluye las inversiones en TES de las entidades así categorizadas por la Superintendencia Financiera de Colombia.

⁵ Incluye las inversiones en TES, Posición Propia, de las Sociedades Fiduciarias, Sociedades Administradoras de Inversión y Administradoras de Fondos de Pensiones y Cesantías

⁶ Incluye las inversiones en TES de los Fondos Mutuos de Inversión y de los Fondos de Empleados.