

Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B



Fecha de Corte : 31-ago-2022
TRM 4,400.16
UVR 313.4107

Indicadores y Composición General

Condiciones Financieras del Portafolio			
Concepto	(Millones de Pesos)	TES UVR	TOTAL
	Denominación TES PESOS		
Valor Nominal	291,681,935	148,603,060	440,284,995
Valor de Mercado	237,818,657	132,592,277	370,410,934
Cupón Promedio	6.919	14.353	9.428
Descuento Promedio	11.798	15.598	13.080
Vida Media	8.725	10.077	9.181
Duración	5.212	7.391	5.947
Duración Modificada	4.655	6.998	5.446
Participación	66.25%	33.75%	100.00%

Análisis Comparativo

Títulos de Tesorería TES Evolución del Perfil de Deuda (Millones de Pesos)						
Comportamiento Anual y Acumulado						
TOTAL GENERAL	ago-21	ago-22	Variación Anual	dic-21	Var. Acum	Var. Acum %
Valor Nominal	388,225,593	440,284,995	13.41%	397,878,200	42,406,795	10.66%
Valor de Mercado	403,912,639	370,410,934	-8.29%	396,934,555	(26,523,621)	-6.68%
Cupón Promedio	7.164	9.428	31.61%	7.644	178 pb	23.34%
Descuento Promedio	6.255	13.080	109.12%	7.771	531 pb	68.31%
Vida Media	8.468	9.181	8.42%	8.647	0.534	6.18%
Duración	6.055	5.947	-1.78%	6.119 -	0.172	-2.81%
Duración Modificada	5.739	5.446	-5.12%	5.761 -	0.315	-5.47%

Variación Anual				Variación Anual			
TES PESOS	ago-21	ago-22	Variación Anual	TES UVR	ago-21	ago-22	Variación Anual
Valor Nominal	265,493,994	291,681,935	9.86%	Valor Nominal	122,731,599	148,603,060	21.08%
Valor de Mercado	275,647,908	237,818,657	-13.72%	Valor de Mercado	128,264,732	132,592,277	3.37%
Cupón Promedio	6.773	6.919	2.16%	Cupón Promedio	8.010	14.353	79.19%
Descuento Promedio	6.059	11.798	94.72%	Descuento Promedio	6.679	15.598	133.52%
Vida Media	7.969	8.725	9.49%	Vida Media	9.549	10.077	5.52%
Duración	5.455	5.212	-4.46%	Duración	7.352	7.391	0.52%
Duración Modificada	5.105	4.655	-8.82%	Duración Modificada	7.111	6.998	-1.59%

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	13,670,569	278,011,366	291,681,935	148,603,060	440,284,995
Valor de Mercado	13,133,982	224,684,675	237,818,657	132,592,277	370,410,934
Cupón Promedio	-	7.259	6.919	14.353	9.428
Descuento Promedio	10.553	11.859	11.798	15.598	13.080
Vida Media	0.396	9.135	8.725	10.077	9.181
Duración	0.396	5.449	5.212	7.391	5.947
Duración Modificada	0.358	4.866	4.655	6.998	5.446

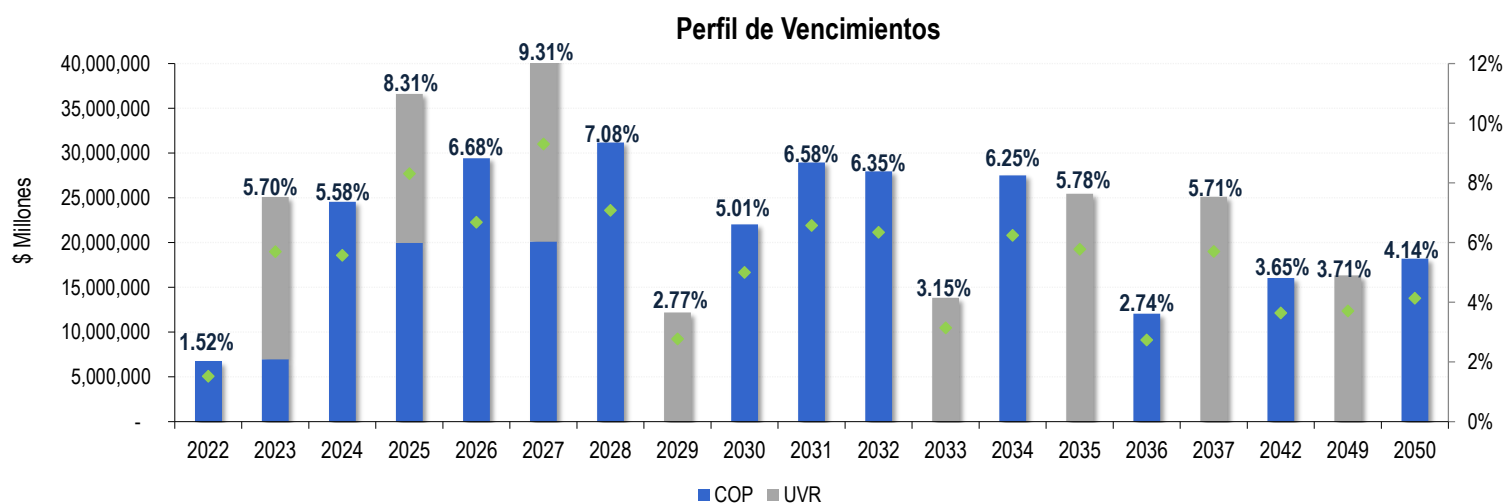
Portafolio por Tipo de Tasa y Denominación en Moneda Original

Concepto	Portafolio de TES por Tipo de Tasa			
	TES PESOS			TES UVR
	Descuento	Fija	Total COP	
Valor Nominal	13,670,569	278,011,366	291,681,935	474,148
Valor de Mercado	13,133,982	224,684,675	237,818,657	423,062
Cupón Promedio	-	7.259	6.919	3.759
Descuento Promedio	10.553	11.859	11.798	4.889
Vida Media	0.396	9.135	8.725	10.077
Duración	0.396	5.449	5.212	7.391
Duración Modificada	0.358	4.866	4.655	6.998

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 PESOS			TES UVR	TOTAL	Participación
	Descuento	Fija	Total COP			
2022	6,704,500	-	6,704,500	-	6,704,500	1.52%
2023	6,966,070	-	6,966,070	18,137,570	25,103,639	5.70%
2024	-	24,563,554	24,563,554	-	24,563,554	5.58%
2025	-	19,952,832	19,952,832	16,648,028	36,600,860	8.31%
2026	-	29,419,494	29,419,494	-	29,419,494	6.68%
2027	-	20,130,204	20,130,204	20,855,833	40,986,037	9.31%
2028	-	31,180,975	31,180,975	-	31,180,975	7.08%
2029	-	-	-	12,205,460	12,205,460	2.77%
2030	-	22,037,127	22,037,127	-	22,037,127	5.01%
2031	-	28,952,566	28,952,566	-	28,952,566	6.58%
2032	-	27,953,498	27,953,498	-	27,953,498	6.35%
2033	-	-	-	13,849,457	13,849,457	3.15%
2034	-	27,505,275	27,505,275	-	27,505,275	6.25%
2035	-	-	-	25,449,986	25,449,986	5.78%
2036	-	12,051,017	12,051,017	-	12,051,017	2.74%
2037	-	-	-	25,124,173	25,124,173	5.71%
2042	-	16,049,875	16,049,875	-	16,049,875	3.65%
2049	-	-	-	16,332,553	16,332,553	3.71%
2050	-	18,214,949	18,214,949	-	18,214,949	4.14%
TOTAL	13.670.569	278.011.366	291.681.935	148.603.060	440.284.995	100%



Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B



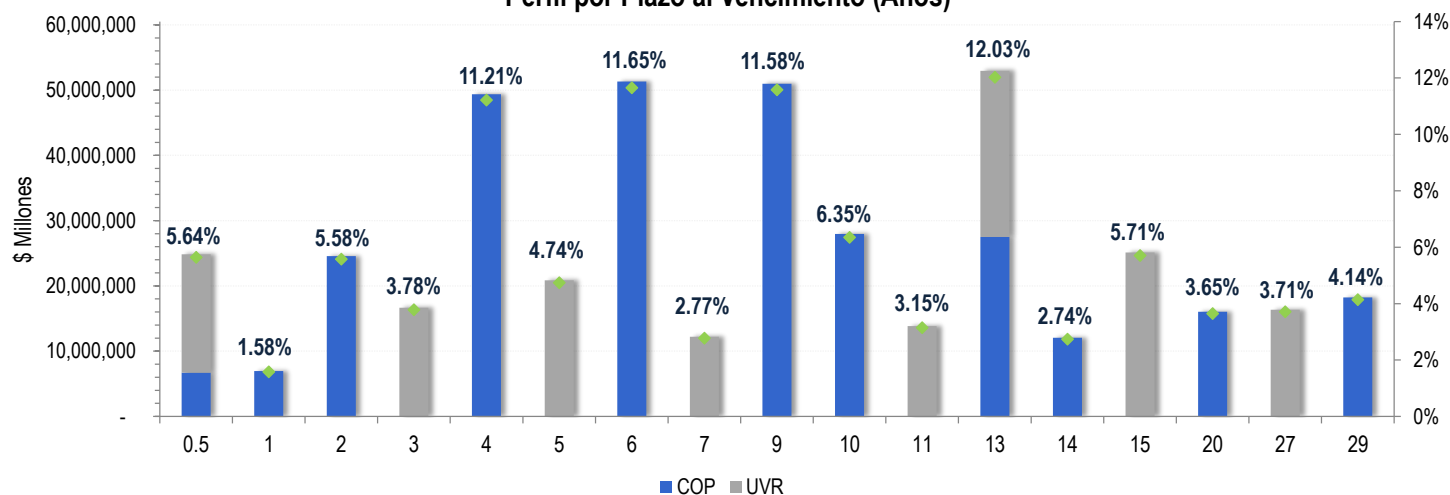
El emprendimiento
es de todos

Minhacienda

Portafolio por Plazo al Vencimiento

Plazo al Vencimiento (Años)	TES PESOS			TES UVR	TOTAL	Participacion
	Descuento	Fija	Total COP			
0.5	6,704,500	-	6,704,500	18,137,570	24,842,069	5.64%
1	6,966,070	-	6,966,070	-	6,966,070	1.58%
2	-	24,563,554	24,563,554	-	24,563,554	5.58%
3	-	-	-	16,648,028	16,648,028	3.78%
4	-	49,372,326	49,372,326	-	49,372,326	11.21%
5	-	-	-	20,855,833	20,855,833	4.74%
6	-	51,311,179	51,311,179	-	51,311,179	11.65%
7	-	-	-	12,205,460	12,205,460	2.77%
9	-	50,989,693	50,989,693	-	50,989,693	11.58%
10	-	27,953,498	27,953,498	-	27,953,498	6.35%
11	-	-	-	13,849,457	13,849,457	3.15%
13	-	27,505,275	27,505,275	25,449,986	52,955,262	12.03%
14	-	12,051,017	12,051,017	-	12,051,017	2.74%
15	-	-	-	25,124,173	25,124,173	5.71%
20	-	16,049,875	16,049,875	-	16,049,875	3.65%
27	-	-	-	16,332,553	16,332,553	3.71%
29	-	18,214,949	18,214,949	-	18,214,949	4.14%
TOTAL	13,670,569	278,011,366	291,681,935	148,603,060	440,284,995	100%

Perfil por Plazo al Vencimiento (Años)



Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B



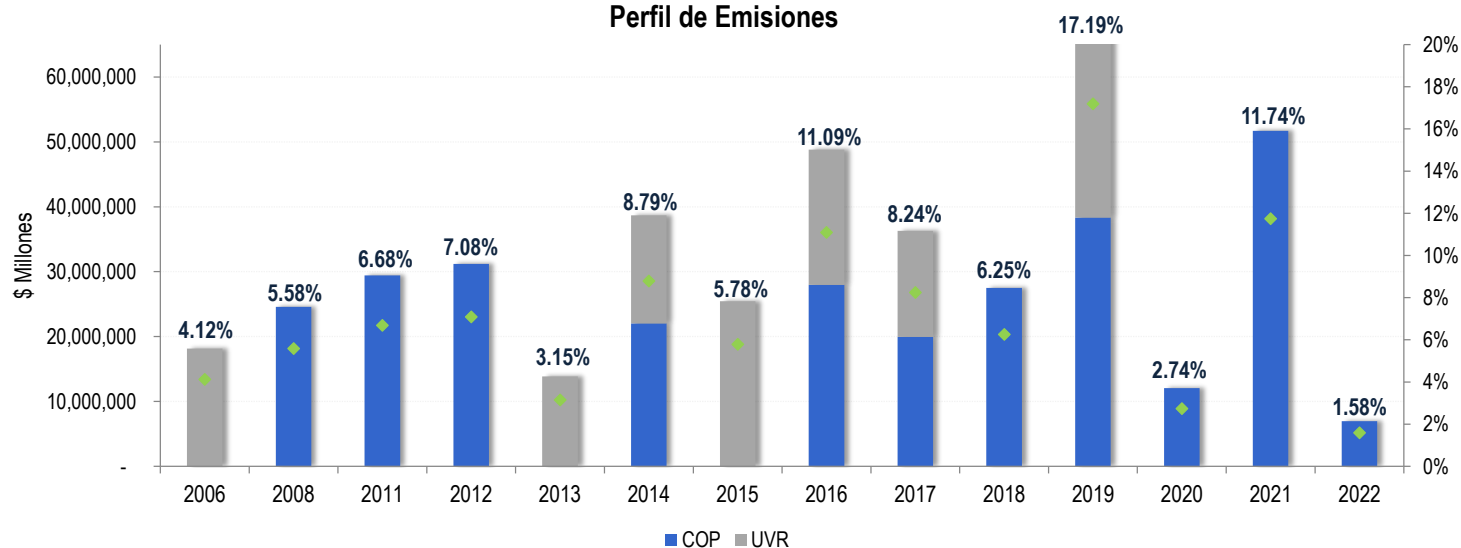
**El emprendimiento
es de todos**

Minhacienda

Portafolio por Año de Emisión

Año Emisión	TES PESOS (Millones de Pesos)			TES UVR	TOTAL	Participación
	Descuento	Fija	Total COP			
2006	-	-	-	18,137,570	18,137,570	4.12%
2008	-	24,563,554	24,563,554	-	24,563,554	5.58%
2011	-	29,419,494	29,419,494	-	29,419,494	6.68%
2012	-	31,180,975	31,180,975	-	31,180,975	7.08%
2013	-	-	-	13,849,457	13,849,457	3.15%
2014	-	22,037,127	22,037,127	16,648,028	38,685,156	8.79%
2015	-	-	-	25,449,986	25,449,986	5.78%
2016	-	27,953,498	27,953,498	20,855,833	48,809,330	11.09%
2017	-	19,952,832	19,952,832	16,332,553	36,285,385	8.24%
2018	-	27,505,275	27,505,275	-	27,505,275	6.25%
2019	-	38,345,153	38,345,153	37,329,632	75,674,785	17.19%
2020	-	12,051,017	12,051,017	-	12,051,017	2.74%
2021	6,704,500	45,002,441	51,706,941	-	51,706,941	11.74%
2022	6,966,070	-	6,966,070	-	6,966,070	1.58%
TOTAL	13,670,569	278,011,366	291,681,935	148,603,060	440,284,995	100%

Perfil de Emisiones



Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B

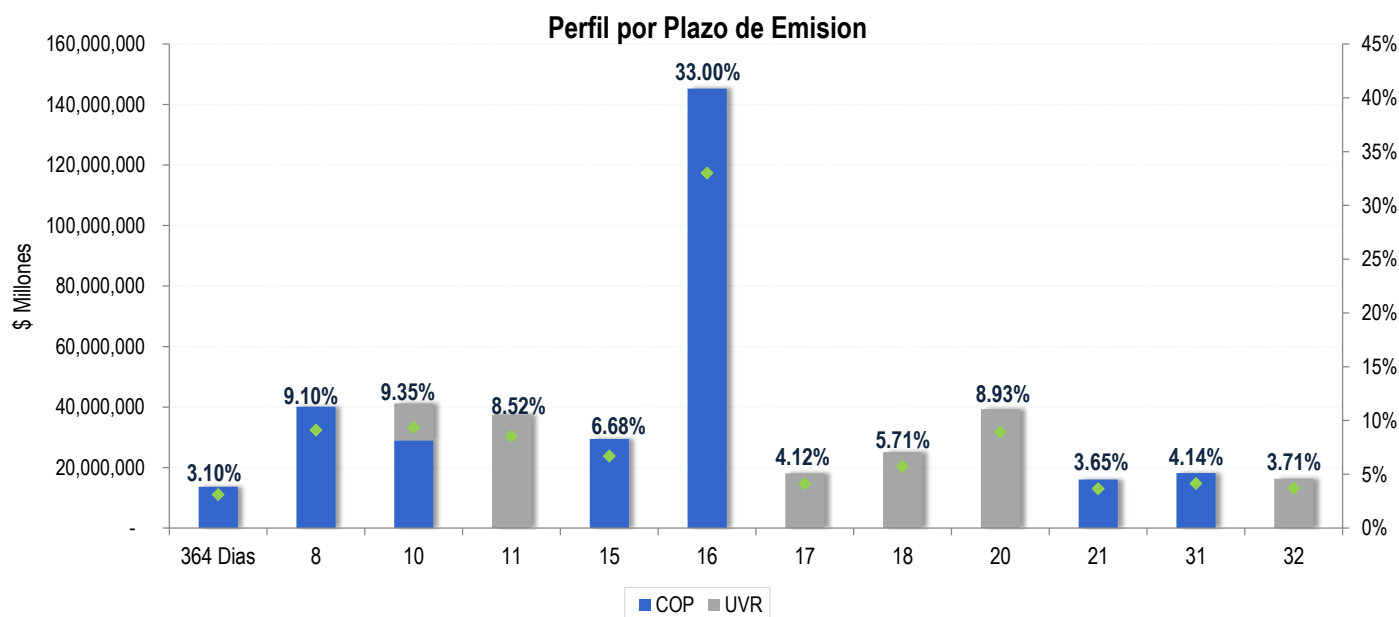


**El emprendimiento
es de todos**

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	13,670,569	-	13,670,569	-	13,670,569	3.10%
8	-	40,083,036	40,083,036	-	40,083,036	9.10%
10	-	28,952,566	28,952,566	12,205,460	41,158,026	9.35%
11	-	-	-	37,503,861	37,503,861	8.52%
15	-	29,419,494	29,419,494	-	29,419,494	6.68%
16	-	145,291,446	145,291,446	-	145,291,446	33.00%
17	-	-	-	18,137,570	18,137,570	4.12%
18	-	-	-	25,124,173	25,124,173	5.71%
20	-	-	-	39,299,443	39,299,443	8.93%
21	-	16,049,875	16,049,875	-	16,049,875	3.65%
31	-	18,214,949	18,214,949	-	18,214,949	4.14%
32	-	-	-	16,332,553	16,332,553	3.71%
TOTAL	13,670,569	278,011,366	291,681,935	148,603,060	440,284,995	100%



Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B



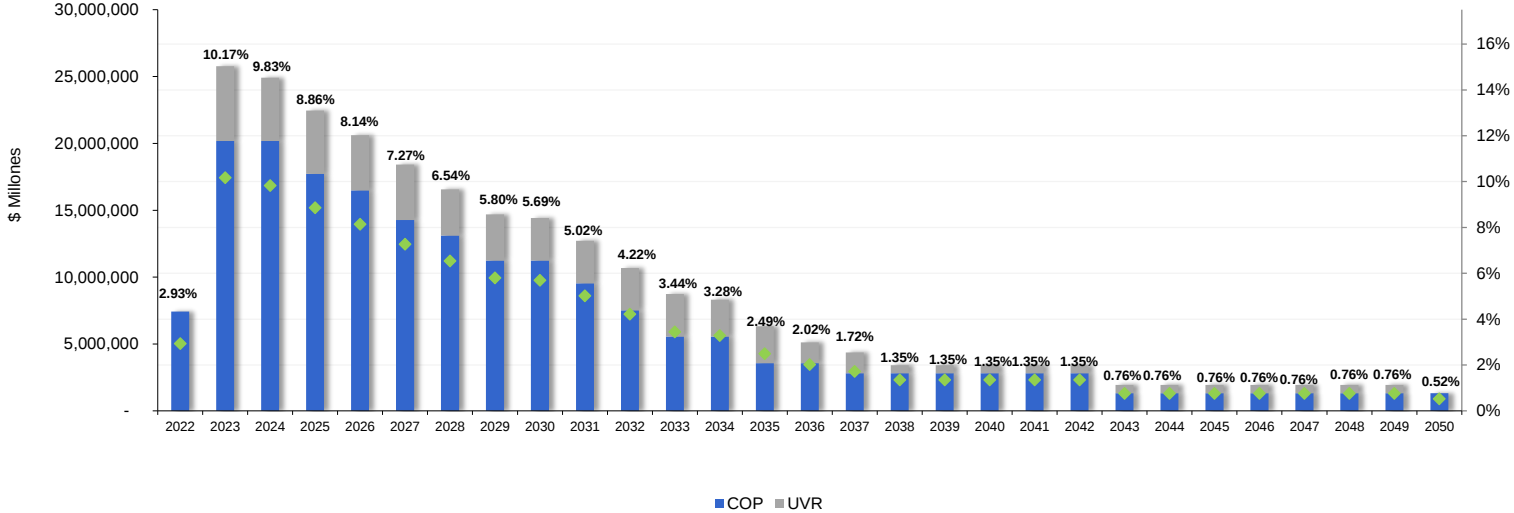
Perfil de Intereses

Año de Pago	Perfil de Intereses (Millones de Pesos)					
	TES PESOS			TES UVR	TOTAL	Participación
	Descuento	Fija	Total COP			
2022	-	7,427,132	7,427,132	-	7,427,132	2.93%
2023	-	20,182,035	20,182,035	5,586,066	25,768,101	10.17%
2024	-	20,182,035	20,182,035	4,724,532	24,906,566	9.83%
2025	-	17,725,679	17,725,679	4,724,532	22,450,211	8.86%
2026	-	16,478,627	16,478,627	4,141,851	20,620,478	8.14%
2027	-	14,272,165	14,272,165	4,141,851	18,414,016	7.27%
2028	-	13,114,679	13,114,679	3,453,608	16,568,287	6.54%
2029	-	11,243,820	11,243,820	3,453,608	14,697,428	5.80%
2030	-	11,243,820	11,243,820	3,178,985	14,422,805	5.69%
2031	-	9,535,943	9,535,943	3,178,985	12,714,928	5.02%
2032	-	7,509,263	7,509,263	3,178,985	10,688,248	4.22%
2033	-	5,552,518	5,552,518	3,178,985	8,731,504	3.44%
2034	-	5,552,518	5,552,518	2,763,502	8,316,020	3.28%
2035	-	3,558,386	3,558,386	2,763,502	6,321,887	2.49%
2036	-	3,558,386	3,558,386	1,554,627	5,113,013	2.02%
2037	-	2,805,197	2,805,197	1,554,627	4,359,824	1.72%
2038	-	2,805,197	2,805,197	612,471	3,417,668	1.35%
2039	-	2,805,197	2,805,197	612,471	3,417,668	1.35%
2040	-	2,805,197	2,805,197	612,471	3,417,668	1.35%
2041	-	2,805,197	2,805,197	612,471	3,417,668	1.35%
2042	-	2,805,197	2,805,197	612,471	3,417,668	1.35%
2043	-	1,320,584	1,320,584	612,471	1,933,055	0.76%
2044	-	1,320,584	1,320,584	612,471	1,933,055	0.76%
2045	-	1,320,584	1,320,584	612,471	1,933,055	0.76%
2046	-	1,320,584	1,320,584	612,471	1,933,055	0.76%
2047	-	1,320,584	1,320,584	612,471	1,933,055	0.76%
2048	-	1,320,584	1,320,584	612,471	1,933,055	0.76%
2049	-	1,320,584	1,320,584	612,471	1,933,055	0.76%
2050	-	1,320,584	1,320,584	-	1,320,584	0.52%
TOTAL	-	194,532,860	194,532,860	58,927,895	253,460,754	100%

Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B



Perfil de Intereses



Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B



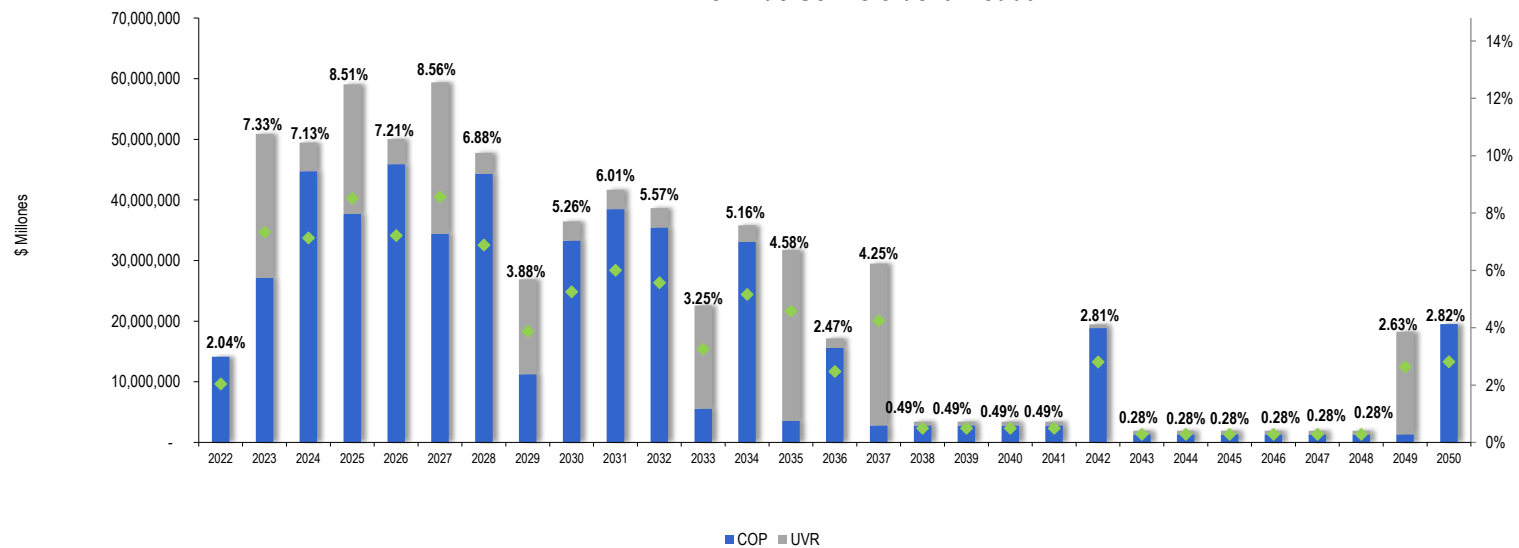
Perfil de Servicio de la Deuda

Año de Pago	Perfil de Servicio de Deuda (Millones de Pesos)					
	TES PESOS			TES UVR	TOTAL	Participación
	Descuento	Fija	Total COP			
2022	6,704,500	7,427,132	14,131,632	-	14,131,632	2.04%
2023	6,966,070	20,182,035	27,148,104	23,723,636	50,871,740	7.33%
2024	-	44,745,589	44,745,589	4,724,532	49,470,120	7.13%
2025	-	37,678,511	37,678,511	21,372,560	59,051,071	8.51%
2026	-	45,898,121	45,898,121	4,141,851	50,039,972	7.21%
2027	-	34,402,370	34,402,370	24,997,684	59,400,053	8.56%
2028	-	44,295,653	44,295,653	3,453,608	47,749,261	6.88%
2029	-	11,243,820	11,243,820	15,659,068	26,902,888	3.88%
2030	-	33,280,947	33,280,947	3,178,985	36,459,933	5.26%
2031	-	38,488,509	38,488,509	3,178,985	41,667,494	6.01%
2032	-	35,462,761	35,462,761	3,178,985	38,641,746	5.57%
2033	-	5,552,518	5,552,518	17,028,442	22,580,961	3.25%
2034	-	33,057,794	33,057,794	2,763,502	35,821,295	5.16%
2035	-	3,558,386	3,558,386	28,213,488	31,771,874	4.58%
2036	-	15,609,403	15,609,403	1,554,627	17,164,030	2.47%
2037	-	2,805,197	2,805,197	26,678,800	29,483,997	4.25%
2038	-	2,805,197	2,805,197	612,471	3,417,668	0.49%
2039	-	2,805,197	2,805,197	612,471	3,417,668	0.49%
2040	-	2,805,197	2,805,197	612,471	3,417,668	0.49%
2041	-	2,805,197	2,805,197	612,471	3,417,668	0.49%
2042	-	18,855,072	18,855,072	612,471	19,467,543	2.81%
2043	-	1,320,584	1,320,584	612,471	1,933,055	0.28%
2044	-	1,320,584	1,320,584	612,471	1,933,055	0.28%
2045	-	1,320,584	1,320,584	612,471	1,933,055	0.28%
2046	-	1,320,584	1,320,584	612,471	1,933,055	0.28%
2047	-	1,320,584	1,320,584	612,471	1,933,055	0.28%
2048	-	1,320,584	1,320,584	612,471	1,933,055	0.28%
2049	-	1,320,584	1,320,584	16,945,024	18,265,608	2.63%
2050	-	19,535,532	19,535,532	-	19,535,532	2.82%
TOTAL	13.670.569	472.544.226	486.214.795	207.530.954	693.745.749	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 Capital Extranjero ¹	110,692,112	8,265,699	118,957,811	27.02%
Fondos de Pensiones y Cesantías	46,733,323	68,628,026	115,361,349	26.20%
Bancos Comerciales	44,782,443	18,229,291	63,011,734	14.31%
Fiducia Publica	28,164,173	11,621,492	39,785,665	9.04%
Banco de la Republica	29,354,049	5,429,140	34,783,189	7.90%
Compañías de Seguros y Capitalizacion	7,244,858	22,863,694	30,108,551	6.84%
Instituciones Oficiales Especiales ²	13,662,178	4,944,463	18,606,641	4.23%
Ministerio de Hacienda y CP	586,045	4,408,374	4,994,419	1.13%
Carteras Colectivas y Fondos Administrados ³	3,039,371	1,518,427	4,557,798	1.04%
Fondos de Prima Media	1,597,782	1,281,900	2,879,682	0.65%
Corporaciones Financieras	1,881,560	608,131	2,489,692	0.57%
Personas Juridicas	1,207,630	290,719	1,498,349	0.34%
Entidades Publicas	1,028,198	74,782	1,102,980	0.25%
Proveedores de Infraestructura ⁴	398,933	212,027	610,960	0.14%
Comisionistas de Bolsa	381,457	81,757	463,214	0.11%
Entidades sin Animo de Lucro	357,336	12,536	369,872	0.08%
Administradoras de Carteras Colectivas y de Fdos Pensiones y Cesantías ⁵	236,038	116,119	352,157	0.08%
Personas Naturales	219,177	10,684	229,861	0.05%
Otros Fondos ⁶	71,669	2,664	74,333	0.02%
Compañías de Financiamiento Comercial	38,603	3,134	41,738	0.01%
Cooperativas Grado Super. Caracter Finan	5,000	-	5,000	0.00%
	291,681,935	148,603,060	440,284,995	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.