

Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B



Fecha de Corte : 31-ene-2023
TRM 4,632.20
UVR 327.7106

Indicadores y Composición General

Condiciones Financieras del Portafolio			
Concepto	(Millones de Pesos)	TES UVR	TOTAL
	Denominación TES PESOS		
Valor Nominal	299,784,381	158,601,063	458,385,443
Valor de Mercado	245,961,433	149,550,648	395,512,081
Cupón Promedio	7.058	17.352	10.620
Descuento Promedio	12.076	17.799	14.056
Vida Media	8.585	10.212	9.148
Duración	5.098	7.472	5.919
Duración Modificada	4.545	7.114	5.434
Participación	65.40%	34.60%	100.00%

Análisis Comparativo

Títulos de Tesorería TES Evolución del Perfil de Deuda (Millones de Pesos)						
Comportamiento Anual y Acumulado						
TOTAL GENERAL	ene-22	ene-23	Variación Anual	dic-22	Var. Acum	Var. Acum %
Valor Nominal	403,161,476	458,385,443	13.70%	450,616,786	7,768,658	1.72%
Valor de Mercado	391,823,207	395,512,081	0.94%	366,443,977	29,068,104	7.93%
Cupón Promedio	7.758	10.620	36.88%	10.394	23 pb	2.17%
Descuento Promedio	8.440	14.056	66.53%	14.829	-77 pb	-5.22%
Vida Media	8.624	9.148	6.07%	9.223	0.075	-0.81%
Duración	5.976	5.919	-0.94%	5.869	0.050	0.85%
Duración Modificada	5.596	5.434	-2.89%	5.340	0.094	1.77%

Variación Anual				Variación Anual			
TES PESOS	ene-22	ene-23	Variación Anual	TES UVR	ene-22	ene-23	Variación Anual
Valor Nominal	270,324,138	299,784,381	10.90%	Valor Nominal	132,837,338	158,601,063	19.39%
Valor de Mercado	254,004,752	245,961,433	-3.17%	Valor de Mercado	137,818,455	149,550,648	8.51%
Cupón Promedio	6.802	7.058	3.77%	Cupón Promedio	9.705	17.352	78.79%
Descuento Promedio	8.366	12.076	44.35%	Descuento Promedio	8.592	17.799	107.15%
Vida Media	8.205	8.585	4.63%	Vida Media	9.477	10.212	7.76%
Duración	5.403	5.098	-5.64%	Duración	7.142	7.472	4.62%
Duración Modificada	4.961	4.545	-8.38%	Duración Modificada	6.887	7.114	3.30%

Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B



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	10,916,069	288,868,312	299,784,381	158,601,063	458,385,443
Valor de Mercado	10,429,253	235,532,179	245,961,433	149,550,648	395,512,081
Cupón Promedio	-	7.325	7.058	17.352	10.620
Descuento Promedio	11.936	12.081	12.076	17.799	14.056
Vida Media	0.401	8.895	8.585	10.212	9.148
Duración	0.401	5.275	5.098	7.472	5.919
Duración Modificada	0.357	4.703	4.545	7.114	5.434

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	10,916,069	288,868,312	299,784,381	483,967
Valor de Mercado	10,429,253	235,532,179	245,961,433	456,350
Cupón Promedio	-	7.325	7.058	3.741
Descuento Promedio	11.936	12.081	12.076	4.136
Vida Media	0.401	8.895	8.585	10.212
Duración	0.401	5.275	5.098	7.472
Duración Modificada	0.357	4.703	4.545	7.114

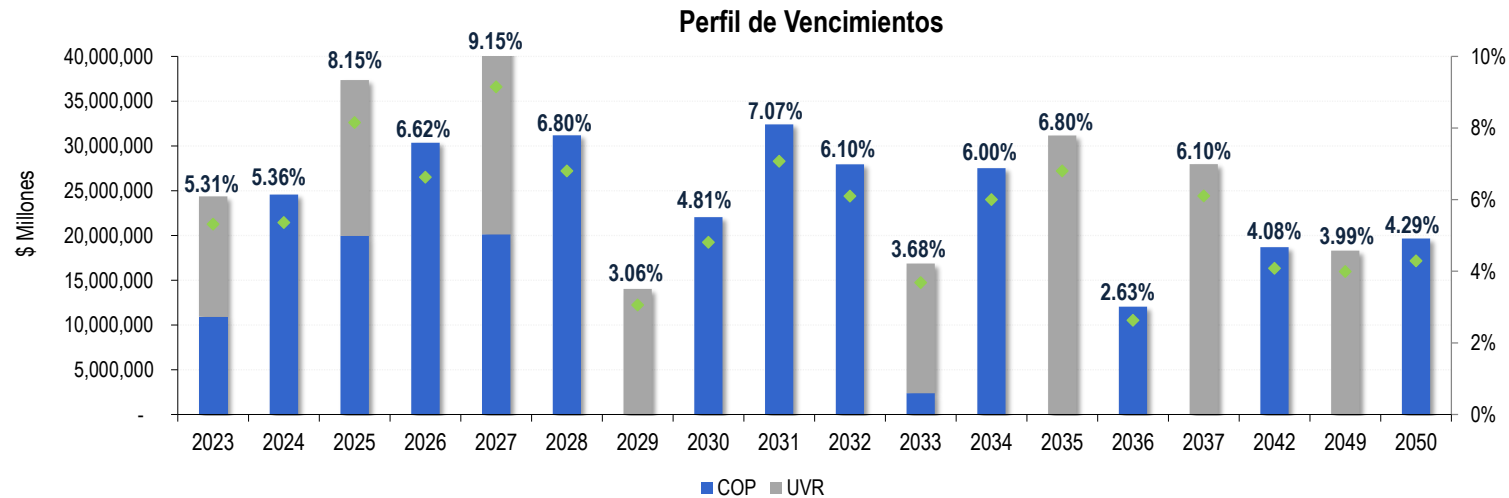
Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B



**MINISTERIO DE HACIENDA Y
CRÉDITO PÚBLICO**

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			
2023	10,916,069	-	10,916,069	13,446,929	24,362,998	5.31%
2024	-	24,563,554	24,563,554	-	24,563,554	5.36%
2025	-	19,952,832	19,952,832	17,407,623	37,360,455	8.15%
2026	-	30,361,994	30,361,994	-	30,361,994	6.62%
2027	-	20,130,204	20,130,204	21,807,416	41,937,620	9.15%
2028	-	31,180,975	31,180,975	-	31,180,975	6.80%
2029	-	-	-	14,022,171	14,022,171	3.06%
2030	-	22,037,127	22,037,127	-	22,037,127	4.81%
2031	-	32,398,863	32,398,863	-	32,398,863	7.07%
2032	-	27,953,498	27,953,498	-	27,953,498	6.10%
2033	-	2,380,177	2,380,177	14,481,362	16,861,539	3.68%
2034	-	27,505,275	27,505,275	-	27,505,275	6.00%
2035	-	-	-	31,172,603	31,172,603	6.80%
2036	-	12,051,017	12,051,017	-	12,051,017	2.63%
2037	-	-	-	27,963,175	27,963,175	6.10%
2042	-	18,698,541	18,698,541	-	18,698,541	4.08%
2049	-	-	-	18,299,784	18,299,784	3.99%
2050	-	19,654,254	19,654,254	-	19,654,254	4.29%
TOTAL	10,916,069	288,868,312	299,784,381	158,601,063	458,385,443	100%

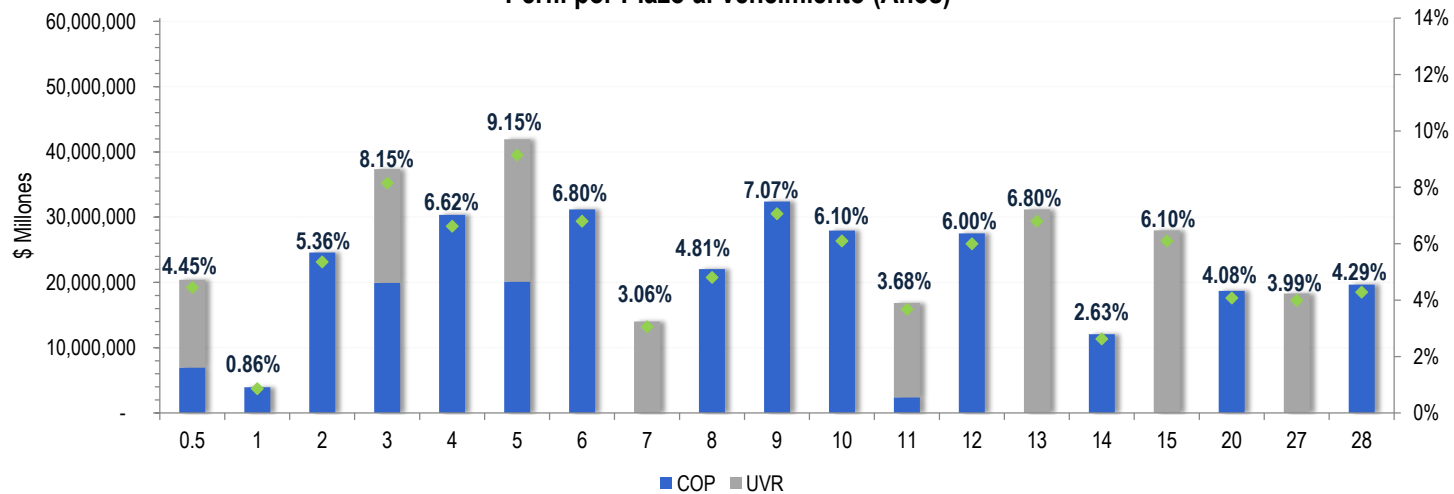


Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B

Portafolio por Plazo al Vencimiento

Plazo al Vencimiento (Años)	Portafolio por Plazo al Vencimiento (Millones de Pesos)			TES UVR	TOTAL	Participacion
	Descuento	TES PESOS Fija	Total COP			
0.5	6,966,070	-	6,966,070	13,446,929	20,412,998	4.45%
1	3,950,000	-	3,950,000	-	3,950,000	0.86%
2	-	24,563,554	24,563,554	-	24,563,554	5.36%
3	-	19,952,832	19,952,832	17,407,623	37,360,455	8.15%
4	-	30,361,994	30,361,994	-	30,361,994	6.62%
5	-	20,130,204	20,130,204	21,807,416	41,937,620	9.15%
6	-	31,180,975	31,180,975	-	31,180,975	6.80%
7	-	-	-	14,022,171	14,022,171	3.06%
8	-	22,037,127	22,037,127	-	22,037,127	4.81%
9	-	32,398,863	32,398,863	-	32,398,863	7.07%
10	-	27,953,498	27,953,498	-	27,953,498	6.10%
11	-	2,380,177	2,380,177	14,481,362	16,861,539	3.68%
12	-	27,505,275	27,505,275	-	27,505,275	6.00%
13	-	-	-	31,172,603	31,172,603	6.80%
14	-	12,051,017	12,051,017	-	12,051,017	2.63%
15	-	-	-	27,963,175	27,963,175	6.10%
20	-	18,698,541	18,698,541	-	18,698,541	4.08%
27	-	-	-	18,299,784	18,299,784	3.99%
28	-	19,654,254	19,654,254	-	19,654,254	4.29%
TOTAL	10,916,069	288,868,312	299,784,381	158,601,063	458,385,443	100%

Perfil por Plazo al Vencimiento (Años)



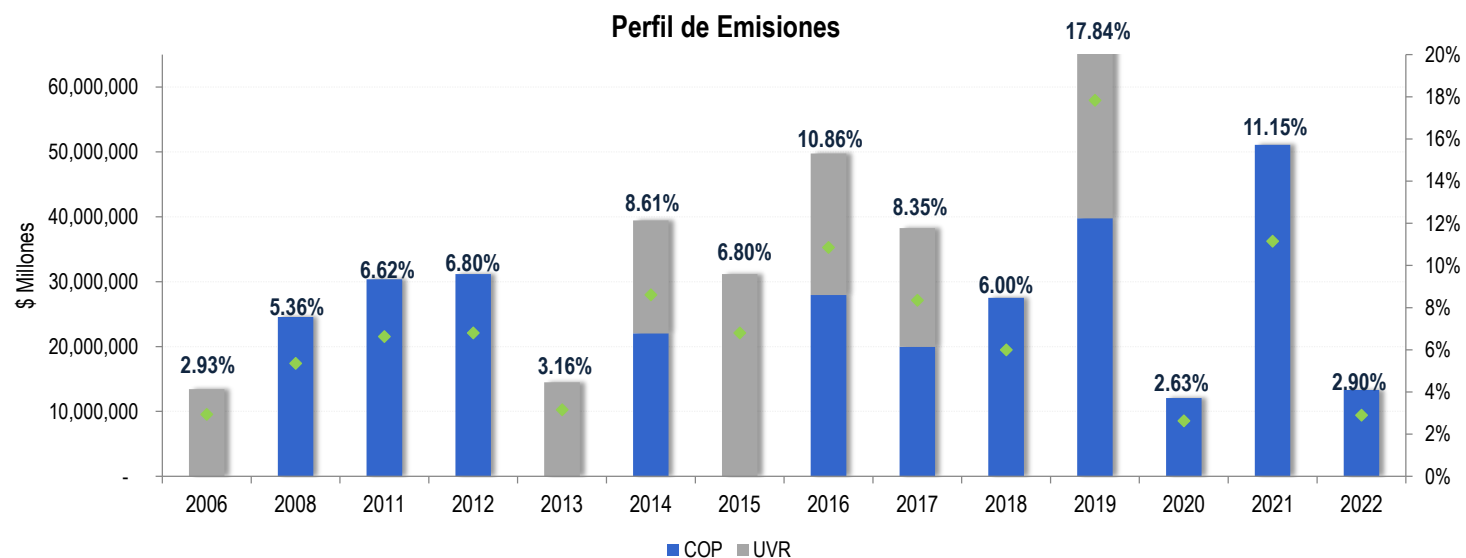
Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B



**MINISTERIO DE HACIENDA Y
CRÉDITO PÚBLICO**

Portafolio por Año de Emisión

Año Emisión	TES PESOS (Millones de Pesos)			TES UVR	TOTAL	Participacion
	Descuento	Fija	Total COP			
2006	-	-	-	13,446,929	13,446,929	2.93%
2008	-	24,563,554	24,563,554	-	24,563,554	5.36%
2011	-	30,361,994	30,361,994	-	30,361,994	6.62%
2012	-	31,180,975	31,180,975	-	31,180,975	6.80%
2013	-	-	-	14,481,362	14,481,362	3.16%
2014	-	22,037,127	22,037,127	17,407,623	39,444,750	8.61%
2015	-	-	-	31,172,603	31,172,603	6.80%
2016	-	27,953,498	27,953,498	21,807,416	49,760,914	10.86%
2017	-	19,952,832	19,952,832	18,299,784	38,252,616	8.35%
2018	-	27,505,275	27,505,275	-	27,505,275	6.00%
2019	-	39,784,458	39,784,458	41,985,346	81,769,804	17.84%
2020	-	12,051,017	12,051,017	-	12,051,017	2.63%
2021	-	51,097,405	51,097,405	-	51,097,405	11.15%
2022	10,916,069	2,380,177	13,296,246	-	13,296,246	2.90%
TOTAL	10,916,069	288,868,312	299,784,381	158,601,063	458,385,443	100%



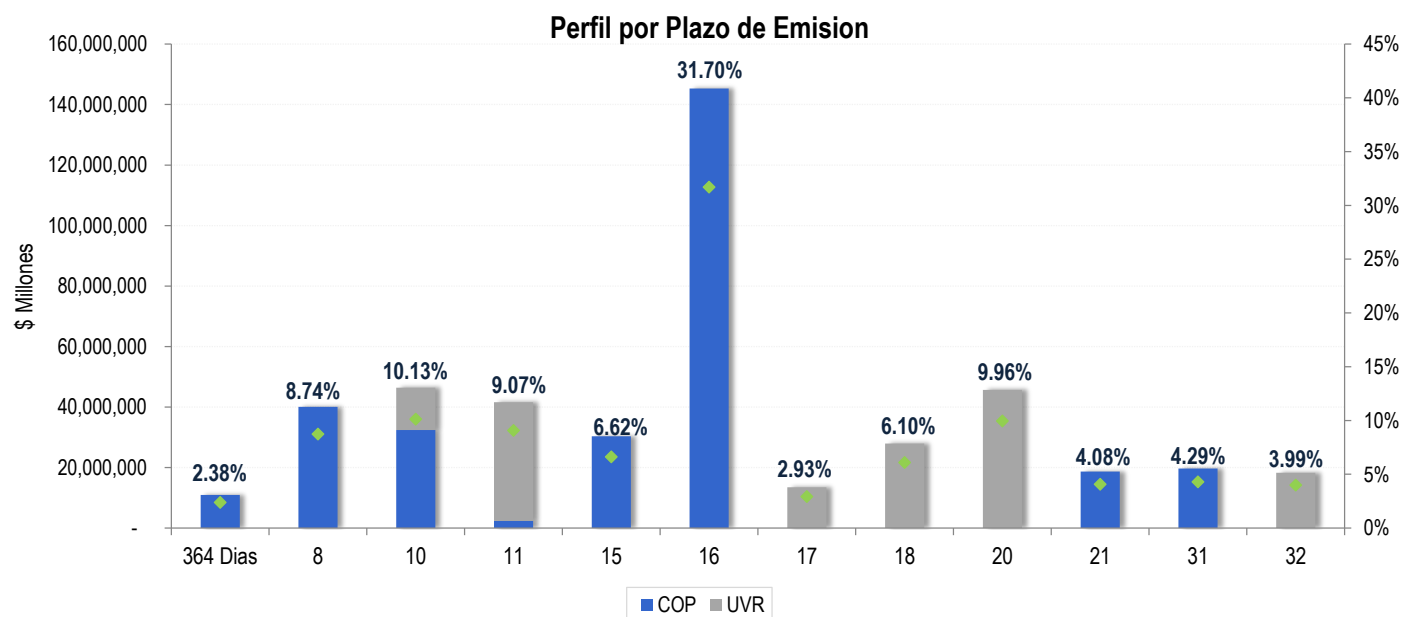
Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B



**MINISTERIO DE HACIENDA Y
CRÉDITO PÚBLICO**

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	10,916,069	-	10,916,069	-	10,916,069	2.38%
8	-	40,083,036	40,083,036	-	40,083,036	8.74%
10	-	32,398,863	32,398,863	14,022,171	46,421,035	10.13%
11	-	2,380,177	2,380,177	39,215,039	41,595,216	9.07%
15	-	30,361,994	30,361,994	-	30,361,994	6.62%
16	-	145,291,446	145,291,446	-	145,291,446	31.70%
17	-	-	-	13,446,929	13,446,929	2.93%
18	-	-	-	27,963,175	27,963,175	6.10%
20	-	-	-	45,653,965	45,653,965	9.96%
21	-	18,698,541	18,698,541	-	18,698,541	4.08%
31	-	19,654,254	19,654,254	-	19,654,254	4.29%
32	-	-	-	18,299,784	18,299,784	3.99%
TOTAL	10,916,069	288,868,312	299,784,381	158,601,063	458,385,443	100%



Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B



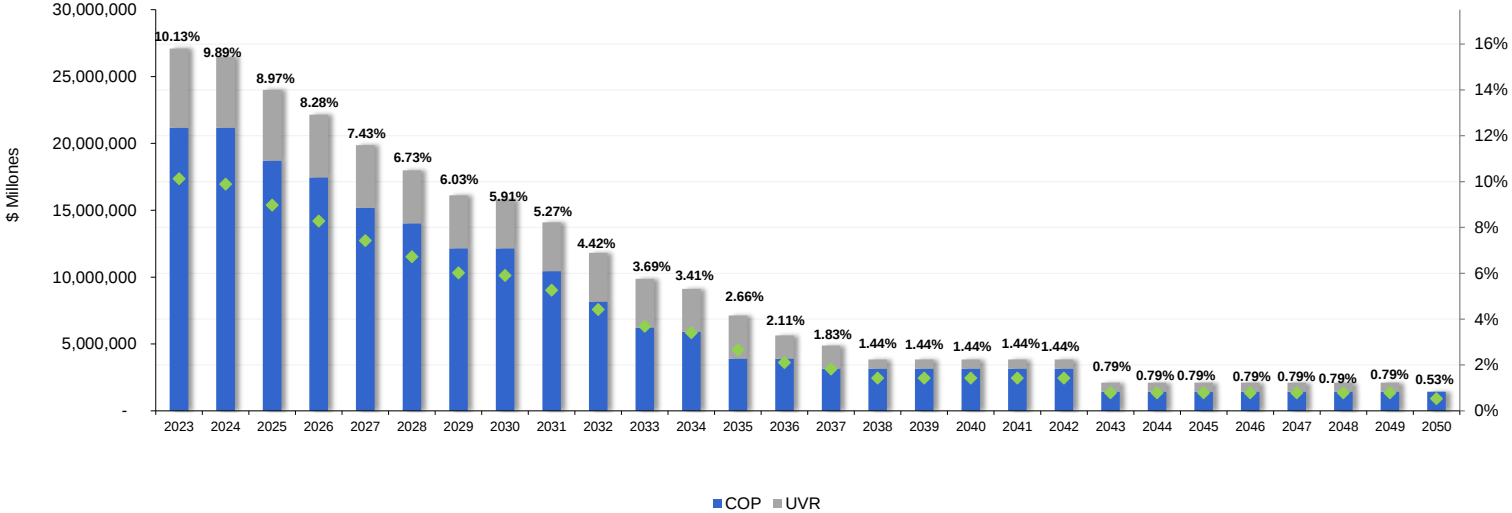
Perfil de Intereses

Año de Pago	Perfil de Intereses (Millones de Pesos)					
	TES PESOS			TES UVR	TOTAL	Participación
	Descuento	Fija	Total COP			
2023	-	21,158,688	21,158,688	5,933,140	27,091,828	10.13%
2024	-	21,158,688	21,158,688	5,294,411	26,453,099	9.89%
2025	-	18,702,332	18,702,332	5,294,411	23,996,743	8.97%
2026	-	17,455,280	17,455,280	4,685,144	22,140,424	8.28%
2027	-	15,178,131	15,178,131	4,685,144	19,863,275	7.43%
2028	-	14,020,644	14,020,644	3,965,499	17,986,143	6.73%
2029	-	12,149,786	12,149,786	3,965,499	16,115,285	6.03%
2030	-	12,149,786	12,149,786	3,650,000	15,799,786	5.91%
2031	-	10,441,908	10,441,908	3,650,000	14,091,909	5.27%
2032	-	8,173,988	8,173,988	3,650,000	11,823,988	4.42%
2033	-	6,217,243	6,217,243	3,650,000	9,867,243	3.69%
2034	-	5,901,870	5,901,870	3,215,560	9,117,429	3.41%
2035	-	3,907,737	3,907,737	3,215,560	7,123,297	2.66%
2036	-	3,907,737	3,907,737	1,734,861	5,642,598	2.11%
2037	-	3,154,548	3,154,548	1,734,861	4,889,409	1.83%
2038	-	3,154,548	3,154,548	686,242	3,840,790	1.44%
2039	-	3,154,548	3,154,548	686,242	3,840,790	1.44%
2040	-	3,154,548	3,154,548	686,242	3,840,790	1.44%
2041	-	3,154,548	3,154,548	686,242	3,840,790	1.44%
2042	-	3,154,548	3,154,548	686,242	3,840,790	1.44%
2043	-	1,424,933	1,424,933	686,242	2,111,175	0.79%
2044	-	1,424,933	1,424,933	686,242	2,111,175	0.79%
2045	-	1,424,933	1,424,933	686,242	2,111,175	0.79%
2046	-	1,424,933	1,424,933	686,242	2,111,175	0.79%
2047	-	1,424,933	1,424,933	686,242	2,111,175	0.79%
2048	-	1,424,933	1,424,933	686,242	2,111,175	0.79%
2049	-	1,424,933	1,424,933	686,242	2,111,175	0.79%
2050	-	1,424,933	1,424,933	-	1,424,933	0.53%
TOTAL	-	200,850,575	200,850,575	66,558,994	267,409,569	100%

Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B



Perfil de Intereses



Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B



**MINISTERIO DE HACIENDA Y
CRÉDITO PÚBLICO**

Perfil de Servicio de la Deuda

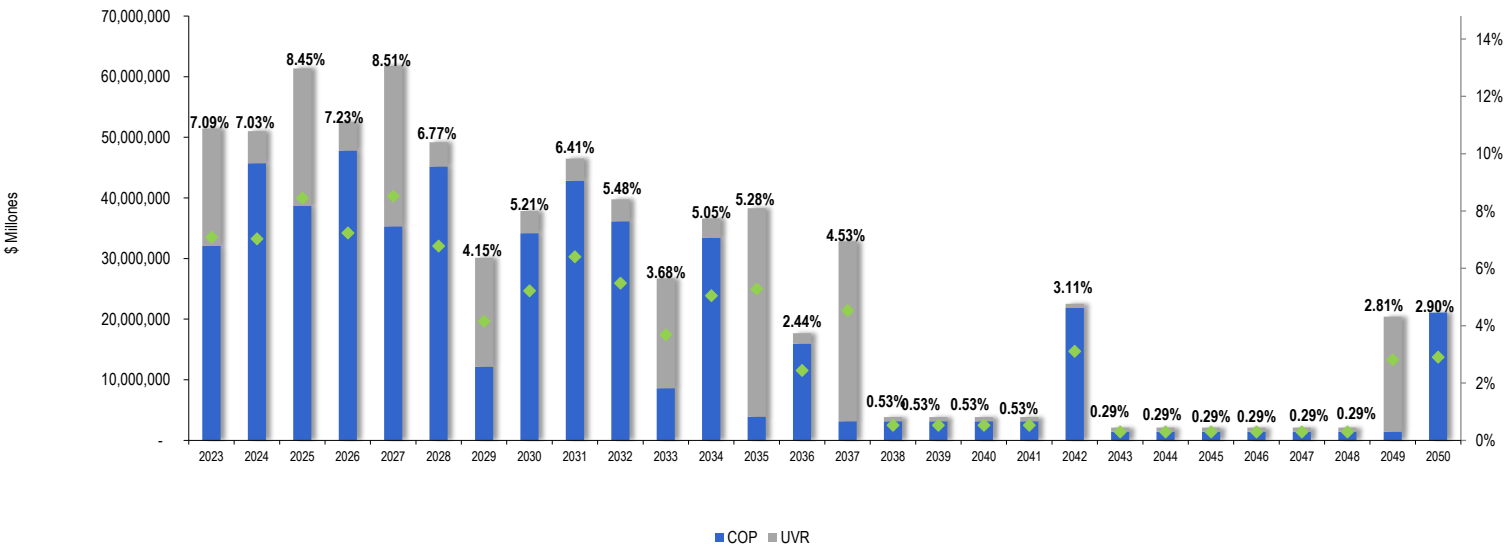
Año de Pago	Perfil de Servicio de Deuda (Millones de Pesos)					
	TES PESOS			TES UVR	TOTAL	Participación
	Descuento	Fija	Total COP			
2023	10,916,069	21,158,688	32,074,757	19,380,069	51,454,826	7.09%
2024	-	45,722,242	45,722,242	5,294,411	51,016,652	7.03%
2025	-	38,655,164	38,655,164	22,702,034	61,357,198	8.45%
2026	-	47,817,274	47,817,274	4,685,144	52,502,418	7.23%
2027	-	35,308,335	35,308,335	26,492,560	61,800,895	8.51%
2028	-	45,201,619	45,201,619	3,965,499	49,167,118	6.77%
2029	-	12,149,786	12,149,786	17,987,671	30,137,456	4.15%
2030	-	34,186,913	34,186,913	3,650,000	37,836,913	5.21%
2031	-	42,840,772	42,840,772	3,650,000	46,490,772	6.41%
2032	-	36,127,485	36,127,485	3,650,000	39,777,486	5.48%
2033	-	8,597,420	8,597,420	18,131,363	26,728,783	3.68%
2034	-	33,407,145	33,407,145	3,215,560	36,622,704	5.05%
2035	-	3,907,737	3,907,737	34,388,163	38,295,900	5.28%
2036	-	15,958,754	15,958,754	1,734,861	17,693,615	2.44%
2037	-	3,154,548	3,154,548	29,698,035	32,852,584	4.53%
2038	-	3,154,548	3,154,548	686,242	3,840,790	0.53%
2039	-	3,154,548	3,154,548	686,242	3,840,790	0.53%
2040	-	3,154,548	3,154,548	686,242	3,840,790	0.53%
2041	-	3,154,548	3,154,548	686,242	3,840,790	0.53%
2042	-	21,853,090	21,853,090	686,242	22,539,332	3.11%
2043	-	1,424,933	1,424,933	686,242	2,111,175	0.29%
2044	-	1,424,933	1,424,933	686,242	2,111,175	0.29%
2045	-	1,424,933	1,424,933	686,242	2,111,175	0.29%
2046	-	1,424,933	1,424,933	686,242	2,111,175	0.29%
2047	-	1,424,933	1,424,933	686,242	2,111,175	0.29%
2048	-	1,424,933	1,424,933	686,242	2,111,175	0.29%
2049	-	1,424,933	1,424,933	18,986,026	20,410,959	2.81%
2050	-	21,079,187	21,079,187	-	21,079,187	2.90%
TOTAL	10,916,069	489,718,886	500,634,955	225,160,057	725,795,012	100%

Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B



**MINISTERIO DE HACIENDA Y
 CRÉDITO PÚBLICO**

Perfil de Servicio de la Deuda



Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B



**MINISTERIO DE HACIENDA Y
CRÉDITO PÚBLICO**

Tenedores

Grupo / Tenedores	Saldo por Grupo de Tenedores (Millones de Pesos)			
	TES PESOS	TES UVR	Total	Participación
Fondos de Capital Extranjero ¹	111,486,045	9,005,236	120,491,281	26.29%
Fondos de Pensiones y Cesantías	44,667,662	68,644,431	113,312,093	24.72%
Bancos Comerciales	44,558,207	20,404,696	64,962,903	14.17%
Banco de la Republica	39,230,030	6,259,359	45,489,390	9.92%
Fiducia Publica	27,052,464	12,788,966	39,841,430	8.69%
Compañías de Seguros y Capitalizacion	7,947,793	30,961,544	38,909,338	8.49%
Instituciones Oficiales Especiales ²	13,502,863	5,232,983	18,735,846	4.09%
Carteras Colectivas y Fondos Administrados ³	3,298,701	2,352,473	5,651,174	1.23%
Fondos de Prima Media	1,599,782	1,358,413	2,958,195	0.65%
Ministerio de Hacienda y CP	1,863,640	118,630	1,982,270	0.43%
Entidades Publicas	1,242,419	146,522	1,388,941	0.30%
Corporaciones Financieras	814,056	432,673	1,246,730	0.27%
Personas Juridicas	962,636	260,166	1,222,803	0.27%
Proveedores de Infraestructura ⁴	516,533	336,400	852,933	0.19%
Comisionistas de Bolsa	322,944	117,448	440,393	0.10%
Entidades sin Animo de Lucro	305,276	65,739	371,015	0.08%
Administradoras de Carteras Colectivas y de Fdos Pensiones y Cesantías ⁵	134,488	94,708	229,196	0.05%
Personas Naturales	181,422	12,122	193,543	0.04%
Otros Fondos ⁶	62,419	5,276	67,695	0.01%
Compañías de Financiamiento Comercial	32,000	3,277	35,277	0.01%
Cooperativas Grado Super. Caracter Finan	3,000	-	3,000	0.00%
	299,784,381	158,601,063	458,385,443	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.