

Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B



Fecha de Corte : 28-feb-2023
TRM 4,808.14
UVR 332.4141

Indicadores y Composición General

Condiciones Financieras del Portafolio			
Concepto	(Millones de Pesos)	TES UVR	TOTAL
	Denominación TES PESOS		
Valor Nominal	304,858,576	148,628,699	453,487,274
Valor de Mercado	243,294,246	134,057,288	377,351,535
Cupón Promedio	7.068	17.380	10.448
Descuento Promedio	12.839	19.147	14.907
Vida Media	8.562	11.152	9.410
Duración	4.915	8.154	5.977
Duración Modificada	4.347	7.734	5.457
Participación	67.23%	32.77%	100.00%

Análisis Comparativo

Títulos de Tesorería TES Evolución del Perfil de Deuda (Millones de Pesos)						
Comportamiento Anual y Acumulado						
TOTAL GENERAL	feb-22	feb-23	Variación Anual	dic-22	Var. Acum	Var. Acum %
Valor Nominal	410,589,895	453,487,274	10.45%	450,616,786	2,870,489	0.64%
Valor de Mercado	391,387,119	377,351,535	-3.59%	366,443,977	10,907,558	2.98%
Cupón Promedio	8.202	10.448	27.37%	10.394	5 pb	0.52%
Descuento Promedio	9.341	14.907	59.59%	14.829	8 pb	0.52%
Vida Media	8.641	9.410	8.91%	9.223	0.188	2.03%
Duración	5.916	5.977	1.02%	5.869	0.107	1.83%
Duración Modificada	5.523	5.457	-1.19%	5.340	0.118	2.20%

Variación Anual				Variación Anual			
TES PESOS	feb-22	feb-23	Variación Anual	TES UVR	feb-22	feb-23	Variación Anual
Valor Nominal	275,250,709	304,858,576	10.76%	Valor Nominal	135,339,186	148,628,699	9.82%
Valor de Mercado	254,355,301	243,294,246	-4.35%	Valor de Mercado	137,031,818	134,057,288	-2.17%
Cupón Promedio	6.791	7.068	4.08%	Cupón Promedio	11.073	17.380	56.96%
Descuento Promedio	8.948	12.839	43.49%	Descuento Promedio	10.139	19.147	88.84%
Vida Media	8.238	8.562	3.93%	Vida Media	9.459	11.152	17.89%
Duración	5.306	4.915	-7.37%	Duración	7.157	8.154	13.93%
Duración Modificada	4.850	4.347	-10.38%	Duración Modificada	6.890	7.734	12.25%

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	12,416,069	292,442,507	304,858,576	148,628,699	453,487,274
Valor de Mercado	11,886,697	231,407,549	243,294,246	134,057,288	377,351,535
Cupón Promedio	-	7.368	7.068	17.380	10.448
Descuento Promedio	12.472	12.855	12.839	19.147	14.907
Vida Media	0.378	8.909	8.562	11.152	9.410
Duración	0.378	5.108	4.915	8.154	5.977
Duración Modificada	0.336	4.517	4.347	7.734	5.457

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	12,416,069	292,442,507	304,858,576	447,119
Valor de Mercado	11,886,697	231,407,549	243,294,246	403,284
Cupón Promedio	-	7.368	7.068	3.647
Descuento Promedio	12.472	12.855	12.839	5.207
Vida Media	0.378	8.909	8.562	11.152
Duración	0.378	5.108	4.915	8.154
Duración Modificada	0.336	4.517	4.347	7.734

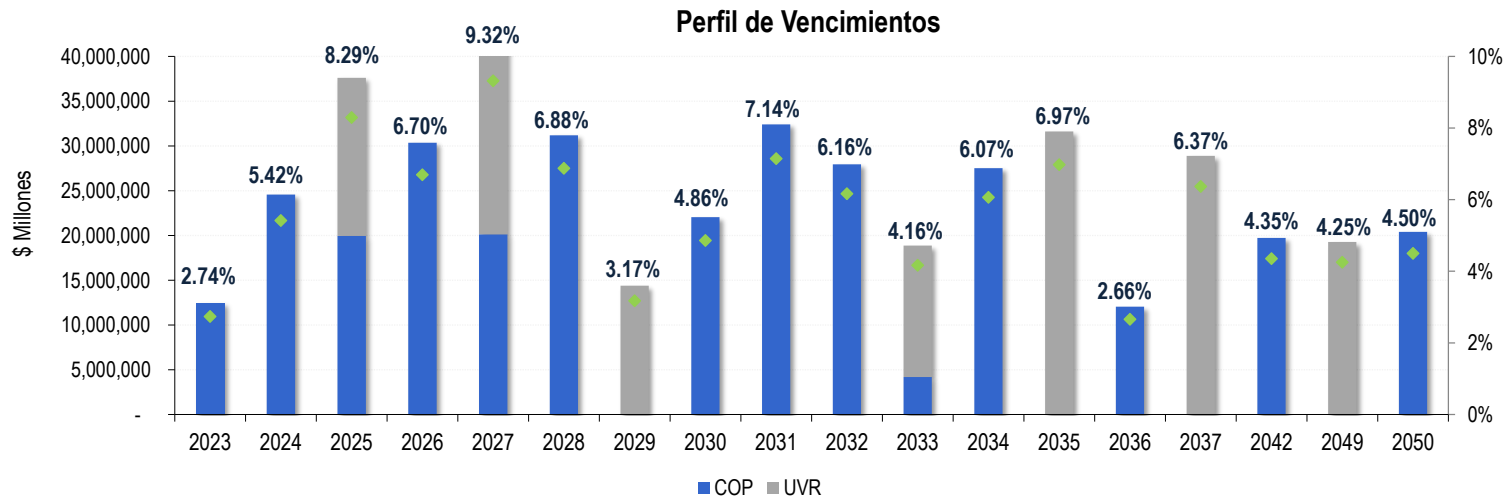
Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B



**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	12,416,069	-	12,416,069	-	12,416,069	2.74%
2024	-	24,563,554	24,563,554	-	24,563,554	5.42%
2025	-	19,952,832	19,952,832	17,657,468	37,610,300	8.29%
2026	-	30,361,994	30,361,994	-	30,361,994	6.70%
2027	-	20,130,204	20,130,204	22,120,409	42,250,614	9.32%
2028	-	31,180,975	31,180,975	-	31,180,975	6.88%
2029	-	-	-	14,396,351	14,396,351	3.17%
2030	-	22,037,127	22,037,127	-	22,037,127	4.86%
2031	-	32,398,863	32,398,863	-	32,398,863	7.14%
2032	-	27,953,498	27,953,498	-	27,953,498	6.16%
2033	-	4,190,538	4,190,538	14,689,208	18,879,746	4.16%
2034	-	27,505,275	27,505,275	-	27,505,275	6.07%
2035	-	-	-	31,620,011	31,620,011	6.97%
2036	-	12,051,017	12,051,017	-	12,051,017	2.66%
2037	-	-	-	28,881,512	28,881,512	6.37%
2042	-	19,727,471	19,727,471	-	19,727,471	4.35%
2049	-	-	-	19,263,741	19,263,741	4.25%
2050	-	20,389,158	20,389,158	-	20,389,158	4.50%
TOTAL	12,416,069	292,442,507	304,858,576	148,628,699	453,487,274	100%



Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B

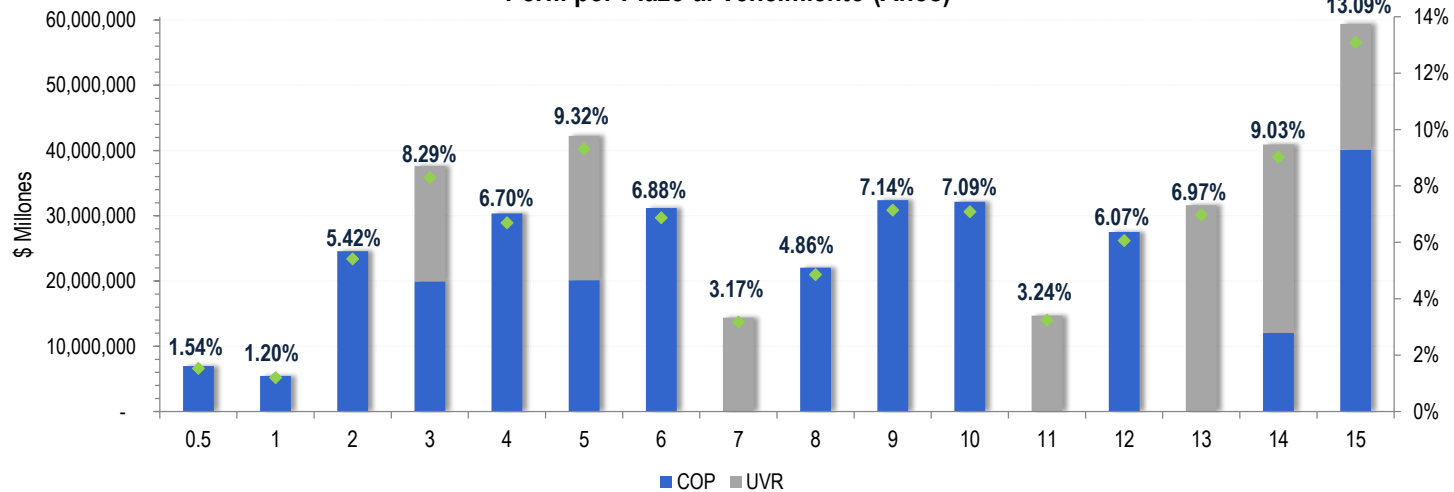


**MINISTERIO DE HACIENDA Y
CRÉDITO PÚBLICO**

Portafolio por Plazo al Vencimiento

Plazo al Vencimiento (Años)	Portafolio por Plazo al Vencimiento (Millones de Pesos)			TES UVR	TOTAL	Participación
	Descuento	TES PESOS Fija	Total COP			
0.5	6,966,070	-	6,966,070	-	6,966,070	1.54%
1	5,449,999	-	5,449,999	-	5,449,999	1.20%
2	-	24,563,554	24,563,554	-	24,563,554	5.42%
3	-	19,952,832	19,952,832	17,657,468	37,610,300	8.29%
4	-	30,361,994	30,361,994	-	30,361,994	6.70%
5	-	20,130,204	20,130,204	22,120,409	42,250,614	9.32%
6	-	31,180,975	31,180,975	-	31,180,975	6.88%
7	-	-	-	14,396,351	14,396,351	3.17%
8	-	22,037,127	22,037,127	-	22,037,127	4.86%
9	-	32,398,863	32,398,863	-	32,398,863	7.14%
10	-	32,144,036	32,144,036	-	32,144,036	7.09%
11	-	-	-	14,689,208	14,689,208	3.24%
12	-	27,505,275	27,505,275	-	27,505,275	6.07%
13	-	-	-	31,620,011	31,620,011	6.97%
14	-	12,051,017	12,051,017	28,881,512	40,932,529	9.03%
15	-	40,116,629	40,116,629	19,263,741	59,380,370	13.09%
TOTAL	12,416,069	292,442,507	304,858,576	148,628,699	453,487,274	100%

Perfil por Plazo al Vencimiento (Años)



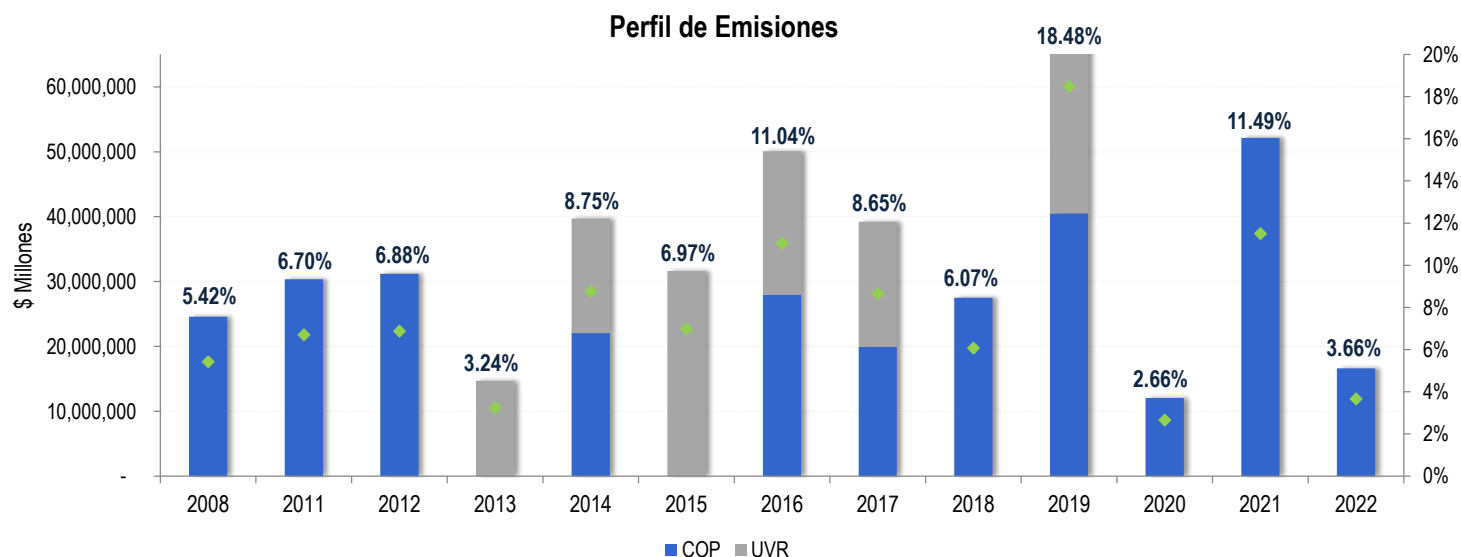
Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B



**MINISTERIO DE HACIENDA Y
CRÉDITO PÚBLICO**

Portafolio por Año de Emisión

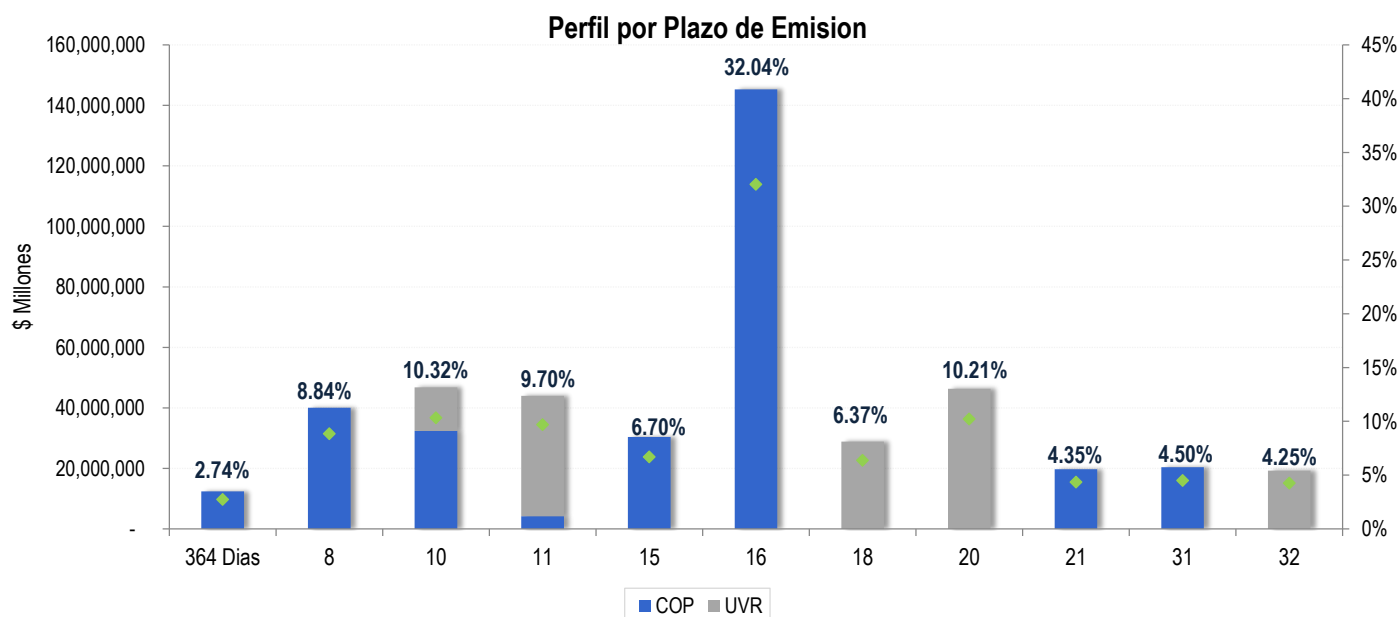
Año Emisión	Portafolio por Año de Emisión (Millones de Pesos)			TES UVR	TOTAL	Participación
	Descuento	Fija	Total COP			
2008	-	24,563,554	24,563,554	-	24,563,554	5.42%
2011	-	30,361,994	30,361,994	-	30,361,994	6.70%
2012	-	31,180,975	31,180,975	-	31,180,975	6.88%
2013	-	-	-	14,689,208	14,689,208	3.24%
2014	-	22,037,127	22,037,127	17,657,468	39,694,595	8.75%
2015	-	-	-	31,620,011	31,620,011	6.97%
2016	-	27,953,498	27,953,498	22,120,409	50,073,907	11.04%
2017	-	19,952,832	19,952,832	19,263,741	39,216,573	8.65%
2018	-	27,505,275	27,505,275	-	27,505,275	6.07%
2019	-	40,519,363	40,519,363	43,277,863	83,797,225	18.48%
2020	-	12,051,017	12,051,017	-	12,051,017	2.66%
2021	-	52,126,334	52,126,334	-	52,126,334	11.49%
2022	12,416,069	4,190,538	16,606,607	-	16,606,607	3.66%
TOTAL	12,416,069	292,442,507	304,858,576	148,628,699	453,487,274	100%



Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B

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	12,416,069	-	12,416,069	-	12,416,069	2.74%
8	-	40,083,036	40,083,036	-	40,083,036	8.84%
10	-	32,398,863	32,398,863	14,396,351	46,795,214	10.32%
11	-	4,190,538	4,190,538	39,777,877	43,968,415	9.70%
15	-	30,361,994	30,361,994	-	30,361,994	6.70%
16	-	145,291,446	145,291,446	-	145,291,446	32.04%
18	-	-	-	28,881,512	28,881,512	6.37%
20	-	-	-	46,309,219	46,309,219	10.21%
21	-	19,727,471	19,727,471	-	19,727,471	4.35%
31	-	20,389,158	20,389,158	-	20,389,158	4.50%
32	-	-	-	19,263,741	19,263,741	4.25%
TOTAL	12,416,069	292,442,507	304,858,576	148,628,699	453,487,274	100%



Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B



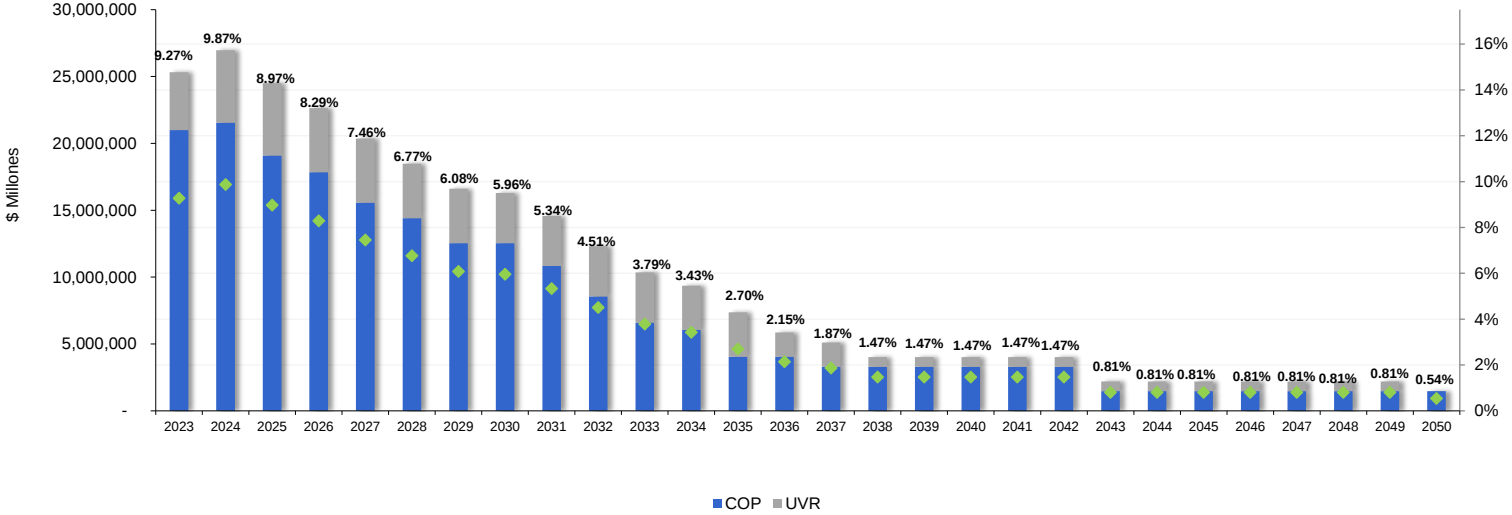
Perfil de Intereses

Año de Pago	Perfil de Intereses (Millones de Pesos)					
	TES PESOS			TES UVR	TOTAL	Participación
	Descuento	Fija	Total COP			
2023	-	20,991,771	20,991,771	4,336,920	25,328,691	9.27%
2024	-	21,547,017	21,547,017	5,419,976	26,966,994	9.87%
2025	-	19,090,662	19,090,662	5,419,976	24,510,638	8.97%
2026	-	17,843,610	17,843,610	4,801,965	22,645,575	8.29%
2027	-	15,566,460	15,566,460	4,801,965	20,368,425	7.46%
2028	-	14,408,973	14,408,973	4,071,992	18,480,965	6.77%
2029	-	12,538,115	12,538,115	4,071,992	16,610,107	6.08%
2030	-	12,538,115	12,538,115	3,748,074	16,286,189	5.96%
2031	-	10,830,238	10,830,238	3,748,074	14,578,311	5.34%
2032	-	8,562,317	8,562,317	3,748,074	12,310,391	4.51%
2033	-	6,605,572	6,605,572	3,748,074	10,353,646	3.79%
2034	-	6,050,326	6,050,326	3,307,397	9,357,724	3.43%
2035	-	4,056,194	4,056,194	3,307,397	7,363,591	2.70%
2036	-	4,056,194	4,056,194	1,805,447	5,861,641	2.15%
2037	-	3,303,005	3,303,005	1,805,447	5,108,452	1.87%
2038	-	3,303,005	3,303,005	722,390	4,025,395	1.47%
2039	-	3,303,005	3,303,005	722,390	4,025,395	1.47%
2040	-	3,303,005	3,303,005	722,390	4,025,395	1.47%
2041	-	3,303,005	3,303,005	722,390	4,025,395	1.47%
2042	-	3,303,005	3,303,005	722,390	4,025,395	1.47%
2043	-	1,478,214	1,478,214	722,390	2,200,604	0.81%
2044	-	1,478,214	1,478,214	722,390	2,200,604	0.81%
2045	-	1,478,214	1,478,214	722,390	2,200,604	0.81%
2046	-	1,478,214	1,478,214	722,390	2,200,604	0.81%
2047	-	1,478,214	1,478,214	722,390	2,200,604	0.81%
2048	-	1,478,214	1,478,214	722,390	2,200,604	0.81%
2049	-	1,478,214	1,478,214	722,390	2,200,604	0.81%
2050	-	1,478,214	1,478,214	-	1,478,214	0.54%
TOTAL	-	206,329,305	206,329,305	66,811,453	273,140,759	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

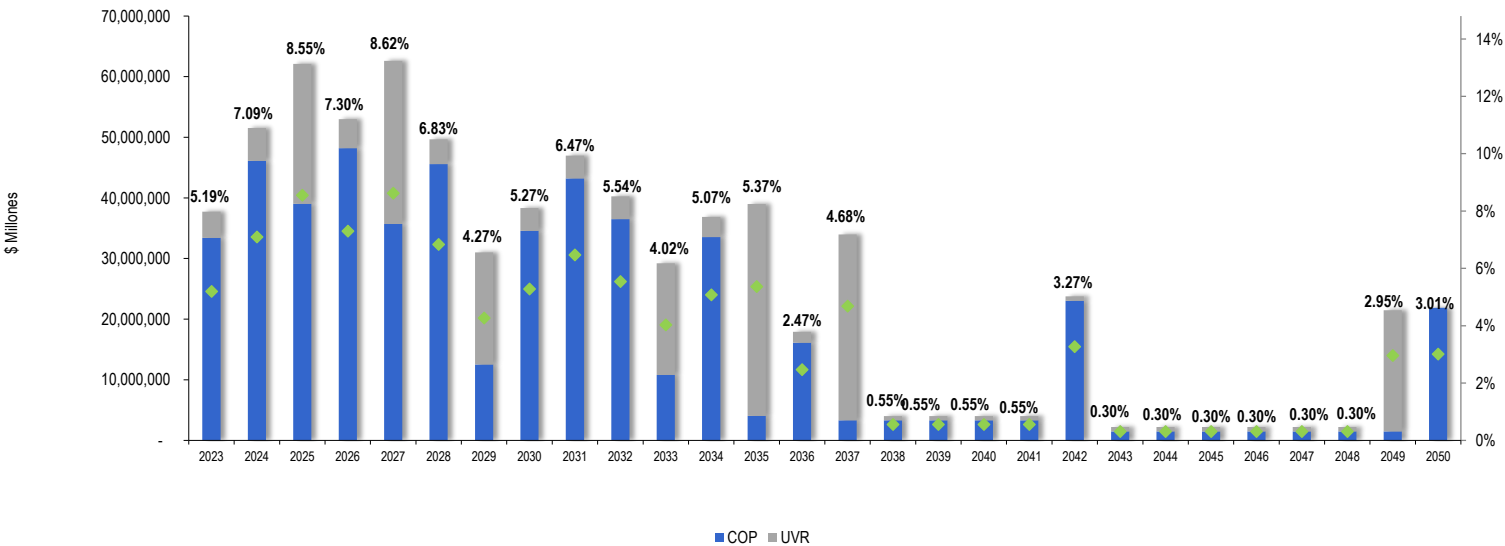
Año de Pago	Perfil de Servicio de Deuda (Millones de Pesos)			TES UVR	TOTAL	Participación
	TES PESOS					
	Descuento	Fija	Total COP			
2023	12,416,069	20,991,771	33,407,840	4,336,920	37,744,760	5.19%
2024	-	46,110,571	46,110,571	5,419,976	51,530,547	7.09%
2025	-	39,043,494	39,043,494	23,077,444	62,120,938	8.55%
2026	-	48,205,604	48,205,604	4,801,965	53,007,569	7.30%
2027	-	35,696,665	35,696,665	26,922,374	62,619,039	8.62%
2028	-	45,589,948	45,589,948	4,071,992	49,661,940	6.83%
2029	-	12,538,115	12,538,115	18,468,343	31,006,458	4.27%
2030	-	34,575,242	34,575,242	3,748,074	38,323,316	5.27%
2031	-	43,229,101	43,229,101	3,748,074	46,977,175	6.47%
2032	-	36,515,815	36,515,815	3,748,074	40,263,888	5.54%
2033	-	10,796,111	10,796,111	18,437,281	29,233,392	4.02%
2034	-	33,555,601	33,555,601	3,307,397	36,862,999	5.07%
2035	-	4,056,194	4,056,194	34,927,409	38,983,602	5.37%
2036	-	16,107,211	16,107,211	1,805,447	17,912,658	2.47%
2037	-	3,303,005	3,303,005	30,686,959	33,989,964	4.68%
2038	-	3,303,005	3,303,005	722,390	4,025,395	0.55%
2039	-	3,303,005	3,303,005	722,390	4,025,395	0.55%
2040	-	3,303,005	3,303,005	722,390	4,025,395	0.55%
2041	-	3,303,005	3,303,005	722,390	4,025,395	0.55%
2042	-	23,030,476	23,030,476	722,390	23,752,866	3.27%
2043	-	1,478,214	1,478,214	722,390	2,200,604	0.30%
2044	-	1,478,214	1,478,214	722,390	2,200,604	0.30%
2045	-	1,478,214	1,478,214	722,390	2,200,604	0.30%
2046	-	1,478,214	1,478,214	722,390	2,200,604	0.30%
2047	-	1,478,214	1,478,214	722,390	2,200,604	0.30%
2048	-	1,478,214	1,478,214	722,390	2,200,604	0.30%
2049	-	1,478,214	1,478,214	19,986,131	21,464,345	2.95%
2050	-	21,867,372	21,867,372	-	21,867,372	3.01%
TOTAL	12,416,069	498,771,812	511,187,881	215,440,152	726,628,033	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	108,163,190	8,158,805	116,321,995	25.65%
Fondos de Pensiones y Cesantías	47,872,145	68,379,336	116,251,480	25.64%
Bancos Comerciales	46,247,288	12,850,830	59,098,118	13.03%
Banco de la Republica	39,230,030	6,349,197	45,579,228	10.05%
Fiducia Publica	27,686,993	12,501,069	40,188,063	8.86%
Compañías de Seguros y Capitalizacion	8,181,293	31,767,744	39,949,037	8.81%
Instituciones Oficiales Especiales ²	13,683,238	4,303,860	17,987,099	3.97%
Carteras Colectivas y Fondos Administrados ³	3,789,834	1,926,753	5,716,586	1.26%
Ministerio de Hacienda y CP	3,252,283	128,270	3,380,553	0.75%
Fondos de Prima Media	1,594,782	790,516	2,385,298	0.53%
Corporaciones Financieras	1,068,975	681,809	1,750,783	0.39%
Entidades Publicas	1,298,419	92,447	1,390,866	0.31%
Personas Juridicas	1,001,236	198,851	1,200,087	0.26%
Proveedores de Infraestructura ⁴	605,033	256,457	861,490	0.19%
Comisionistas de Bolsa	437,075	94,465	531,540	0.12%
Entidades sin Animo de Lucro	342,698	42,582	385,280	0.08%
Administradoras de Carteras Colectivas y de Fdos Pensiones y Cesantías ⁵	134,988	89,752	224,740	0.05%
Personas Naturales	174,156	10,604	184,760	0.04%
Otros Fondos ⁶	59,919	5,352	65,271	0.01%
Compañías de Financiamiento Comercial	32,000	-	32,000	0.01%
Cooperativas Grado Super. Caracter Finan	3,000	-	3,000	0.00%
	304,858,576	148,628,699	453,487,274	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.