

Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B



El emprendimiento
es de todos

Minhacienda

Fecha de Corte : 30-jun-2021
TRM 3,756.67
UVR 283.2928

Indicadores y Composición General

Concepto	Condiciones Financieras del Portafolio		
	(Millones de Pesos)		
	TES PESOS	TES UVR	TOTAL
Valor Nominal	255,105,333	117,315,850	372,421,183
Valor de Mercado	267,424,004	122,223,507	389,647,511
Cupón Promedio	6.854	7.337	7.006
Descuento Promedio	6.094	6.064	6.084
Vida Media	7.833	9.516	8.363
Duración	5.367	7.372	5.998
Duración Modificada	5.022	7.132	5.687
Participación	68.50%	31.50%	100.00%

Análisis Comparativo

Títulos de Tesorería TES						
Evolución del Perfil de Deuda						
(Millones de Pesos)						
Comportamiento Anual y Acumulado						
TOTAL GENERAL	jun-20	jun-21	Variación Anual	dic-20	Var. Acum	Var. Acum %
Valor Nominal	328,877,413	372,421,183	13.24%	347,949,545	24,471,638	7.03%
Valor de Mercado	361,079,900	389,647,511	7.91%	397,464,879	(7,817,368)	-1.97%
Cupón Promedio	6.918	7.006	1.27%	6.458	55 pb	8.48%
Descuento Promedio	5.118	6.084	18.89%	3.964	212 pb	53.47%
Vida Media	6.970	8.363	19.99%	7.805	0.558	7.15%
Duración	5.439	5.998	10.29%	5.892	0.106	1.81%
Duración Modificada	5.201	5.687	9.35%	5.665	0.022	0.38%

TES PESOS	Variación Anual			TES UVR	Variación Anual		
	jun-20	jun-21	Variación Anual		jun-20	jun-21	Variación Anual
Valor Nominal	218,119,086	255,105,333	16.96%	Valor Nominal	110,758,327	117,315,850	5.92%
Valor de Mercado	243,625,227	267,424,004	9.77%	Valor de Mercado	117,454,672	122,223,507	4.06%
Cupón Promedio	6.928	6.854	-1.07%	Cupón Promedio	6.899	7.337	6.35%
Descuento Promedio	4.874	6.094	25.04%	Descuento Promedio	5.598	6.064	8.32%
Vida Media	6.490	7.833	20.69%	Vida Media	7.915	9.516	20.22%
Duración	4.960	5.367	8.20%	Duración	6.382	7.372	15.51%
Duración Modificada	4.699	5.022	6.89%	Duración Modificada	6.189	7.132	15.23%

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	11,061,999	244,043,334	255,105,333	117,315,850	372,421,183
Valor de Mercado	10,925,341	256,498,662	267,424,004	122,223,507	389,647,511
Cupón Promedio	-	7.164	6.854	7.337	7.006
Descuento Promedio	2.332	6.264	6.094	6.064	6.084
Vida Media	0.498	8.165	7.833	9.516	8.363
Duración	0.498	5.587	5.367	7.372	5.998
Duración Modificada	0.486	5.228	5.022	7.132	5.687

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	11,061,999	244,043,334	255,105,333	414,115
Valor de Mercado	10,925,341	256,498,662	267,424,004	431,439
Cupón Promedio	-	7.164	6.854	3.908
Descuento Promedio	2.332	6.264	6.094	2.676
Vida Media	0.498	8.165	7.833	9.516
Duración	0.498	5.587	5.367	7.372
Duración Modificada	0.486	5.228	5.022	7.132

Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B



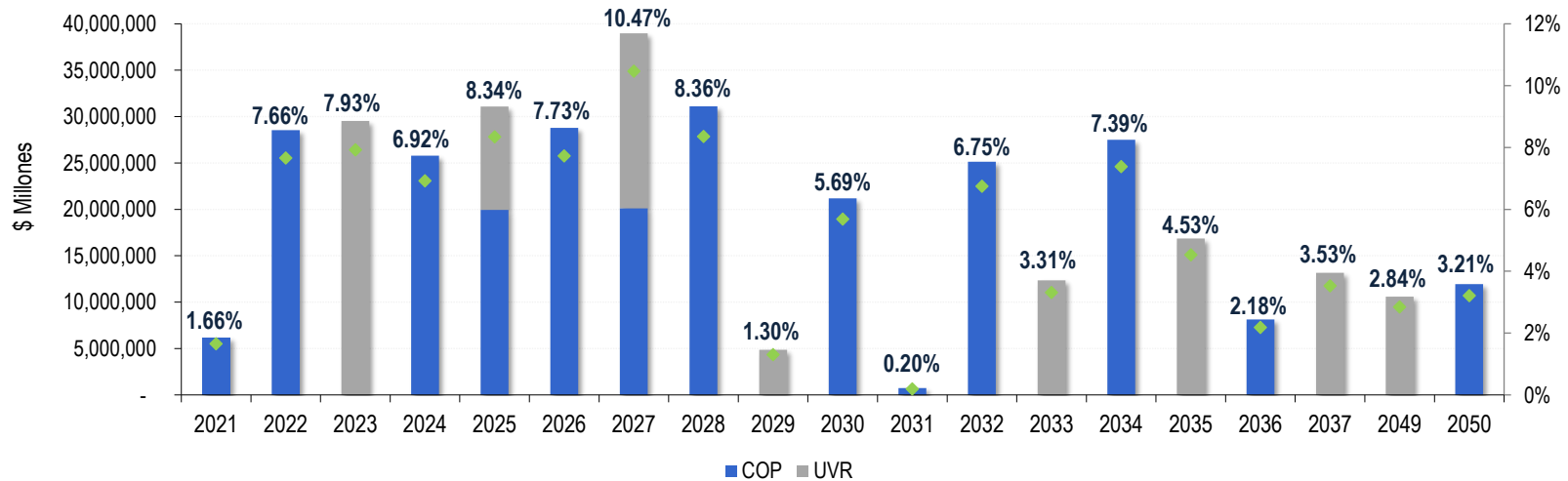
El emprendimiento
es de todos

Minhacienda

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			
2021	6,175,399	-	6,175,399	-	6,175,399	1.66%
2022	4,886,600	23,659,109	28,545,709	-	28,545,709	7.66%
2023	-	-	-	29,527,913	29,527,913	7.93%
2024	-	25,779,228	25,779,228	-	25,779,228	6.92%
2025	-	19,952,832	19,952,832	11,124,328	31,077,159	8.34%
2026	-	28,778,994	28,778,994	-	28,778,994	7.73%
2027	-	20,130,204	20,130,204	18,851,645	38,981,850	10.47%
2028	-	31,116,142	31,116,142	-	31,116,142	8.36%
2029	-	-	-	4,853,128	4,853,128	1.30%
2030	-	21,186,760	21,186,760	-	21,186,760	5.69%
2031	-	728,208	728,208	-	728,208	0.20%
2032	-	25,128,498	25,128,498	-	25,128,498	6.75%
2033	-	-	-	12,344,738	12,344,738	3.31%
2034	-	27,505,275	27,505,275	-	27,505,275	7.39%
2035	-	-	-	16,867,355	16,867,355	4.53%
2036	-	8,132,877	8,132,877	-	8,132,877	2.18%
2037	-	-	-	13,152,538	13,152,538	3.53%
2049	-	-	-	10,594,205	10,594,205	2.84%
2050	-	11,945,207	11,945,207	-	11,945,207	3.21%
TOTAL	11,061,999	244,043,334	255,105,333	117,315,850	372,421,183	100%

Perfil de Vencimientos



Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B



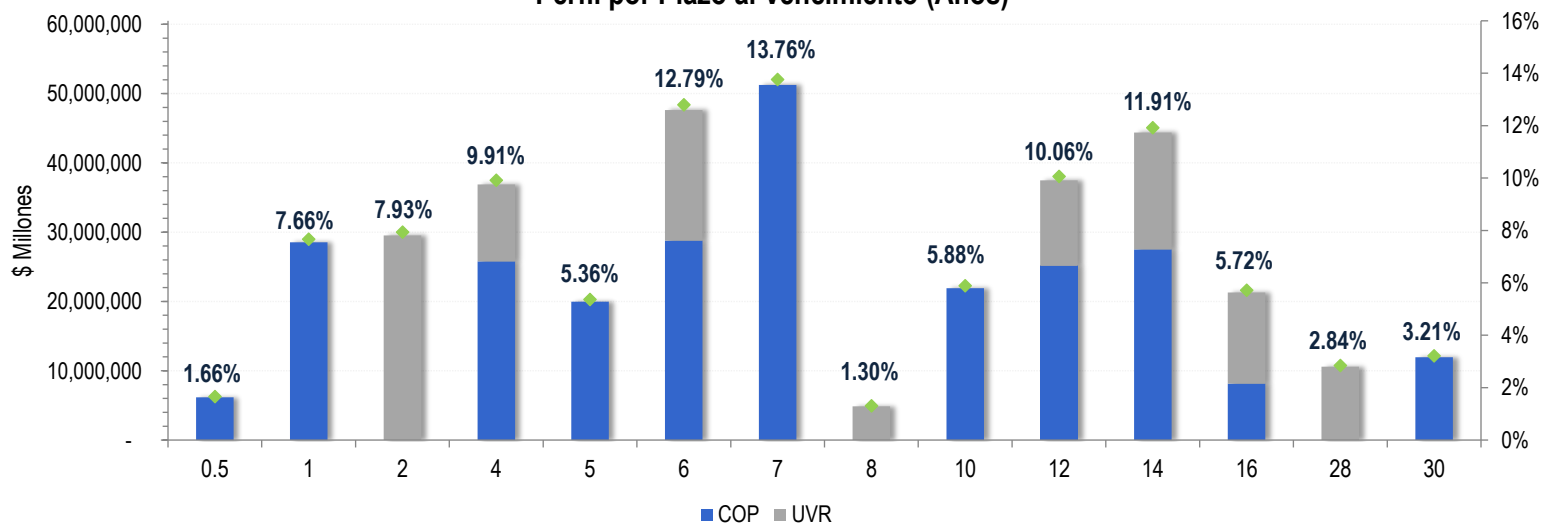
El emprendimiento
es de todos

Minhacienda

Portafolio por Plazo al Vencimiento

Plazo al Vencimiento (Años)	TES PESOS (Millones de Pesos)			TES UVR	TOTAL	Participacion
	Descuento	Fija	Total COP			
0.5	6,175,399	-	6,175,399	-	6,175,399	1.66%
1	4,886,600	23,659,109	28,545,709	-	28,545,709	7.66%
2	-	-	-	29,527,913	29,527,913	7.93%
4	-	25,779,228	25,779,228	11,124,328	36,903,555	9.91%
5	-	19,952,832	19,952,832	-	19,952,832	5.36%
6	-	28,778,994	28,778,994	18,851,645	47,630,639	12.79%
7	-	51,246,347	51,246,347	-	51,246,347	13.76%
8	-	-	-	4,853,128	4,853,128	1.30%
10	-	21,914,968	21,914,968	-	21,914,968	5.88%
12	-	25,128,498	25,128,498	12,344,738	37,473,236	10.06%
14	-	27,505,275	27,505,275	16,867,355	44,372,631	11.91%
16	-	8,132,877	8,132,877	13,152,538	21,285,415	5.72%
28	-	-	-	10,594,205	10,594,205	2.84%
30	-	11,945,207	11,945,207	-	11,945,207	3.21%
TOTAL	11,061,999	244,043,334	255,105,333	117,315,850	372,421,183	100%

Perfil por Plazo al Vencimiento (Años)



Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B



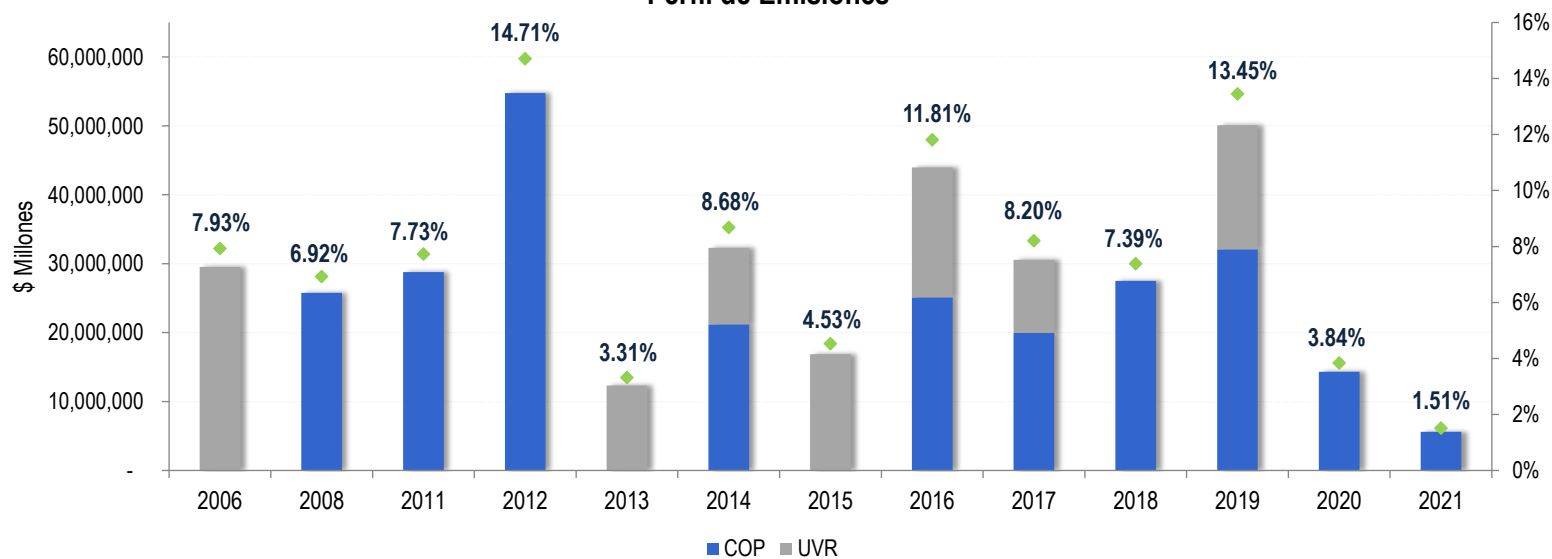
El emprendimiento
es de todos

Minhacienda

Portafolio por Año de Emisión

Año Emisión	Portafolio por Año de Emisión (Millones de Pesos)						Participación
	TES PESOS			TES UVR	TOTAL		
	Descuento	Fija	Total COP				
2006	-	-	-	29,527,913	29,527,913	7.93%	
2008	-	25,779,228	25,779,228	-	25,779,228	6.92%	
2011	-	28,778,994	28,778,994	-	28,778,994	7.73%	
2012	-	54,775,251	54,775,251	-	54,775,251	14.71%	
2013	-	-	-	12,344,738	12,344,738	3.31%	
2014	-	21,186,760	21,186,760	11,124,328	32,311,088	8.68%	
2015	-	-	-	16,867,355	16,867,355	4.53%	
2016	-	25,128,498	25,128,498	18,851,645	43,980,143	11.81%	
2017	-	19,952,832	19,952,832	10,594,205	30,547,036	8.20%	
2018	-	27,505,275	27,505,275	-	27,505,275	7.39%	
2019	-	32,075,412	32,075,412	18,005,666	50,081,078	13.45%	
2020	6,175,399	8,132,877	14,308,276	-	14,308,276	3.84%	
2021	4,886,600	728,208	5,614,808	-	5,614,808	1.51%	
TOTAL	11,061,999	244,043,334	255,105,333	117,315,850	372,421,183	100%	

Perfil de Emisiones



Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B

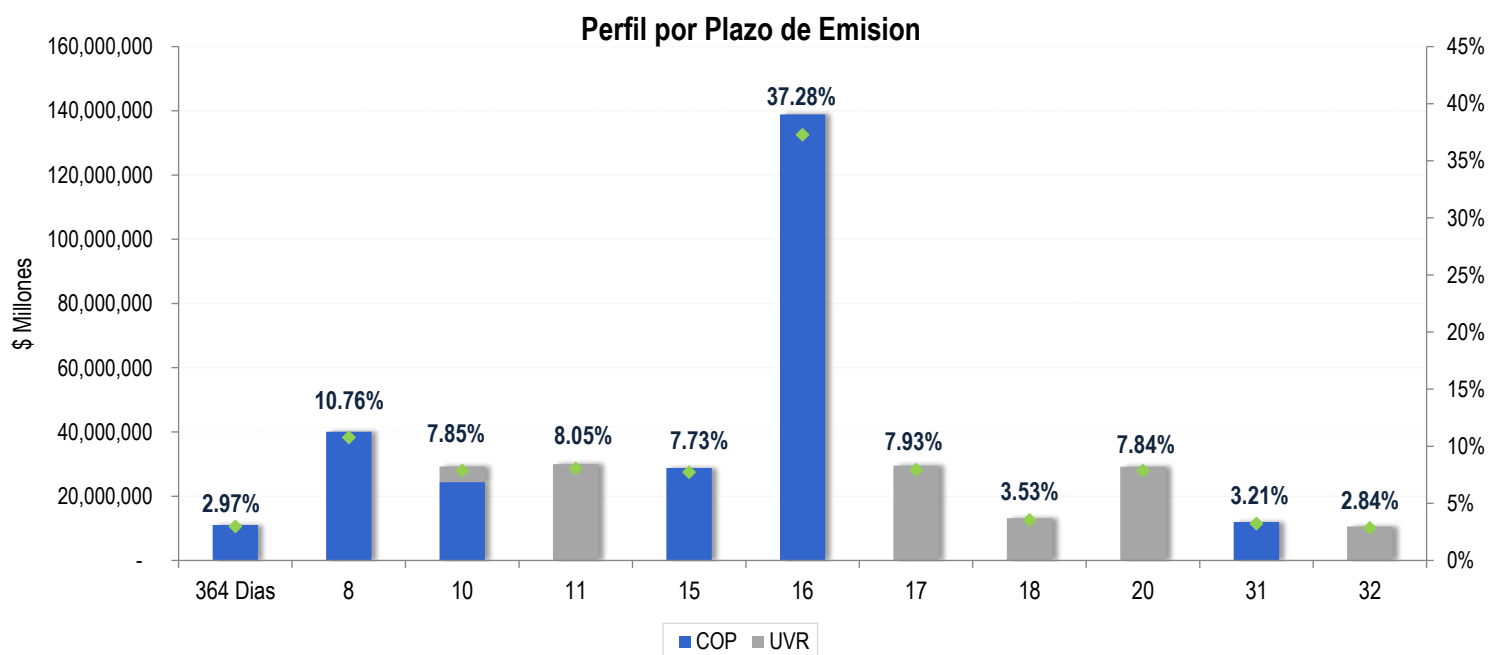


El emprendimiento
es de todos

Minhacienda

Portafolio por Plazo de Emisión

Plazo de Emisión (Años)	Portafolio por Plazo de Emisión (Millones de Pesos)			TES UVR	TOTAL	Participación
	Descuento	Fija	Total COP			
364 Dias	11,061,999	-	11,061,999	-	11,061,999	2.97%
8	-	40,083,036	40,083,036	-	40,083,036	10.76%
10	-	24,387,317	24,387,317	4,853,128	29,240,445	7.85%
11	-	-	-	29,975,973	29,975,973	8.05%
15	-	28,778,994	28,778,994	-	28,778,994	7.73%
16	-	138,848,780	138,848,780	-	138,848,780	37.28%
17	-	-	-	29,527,913	29,527,913	7.93%
18	-	-	-	13,152,538	13,152,538	3.53%
20	-	-	-	29,212,094	29,212,094	7.84%
31	-	11,945,207	11,945,207	-	11,945,207	3.21%
32	-	-	-	10,594,205	10,594,205	2.84%
TOTAL	11,061,999	244,043,334	255,105,333	117,315,850	372,421,183	100%



Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B



**El emprendimiento
es de todos**

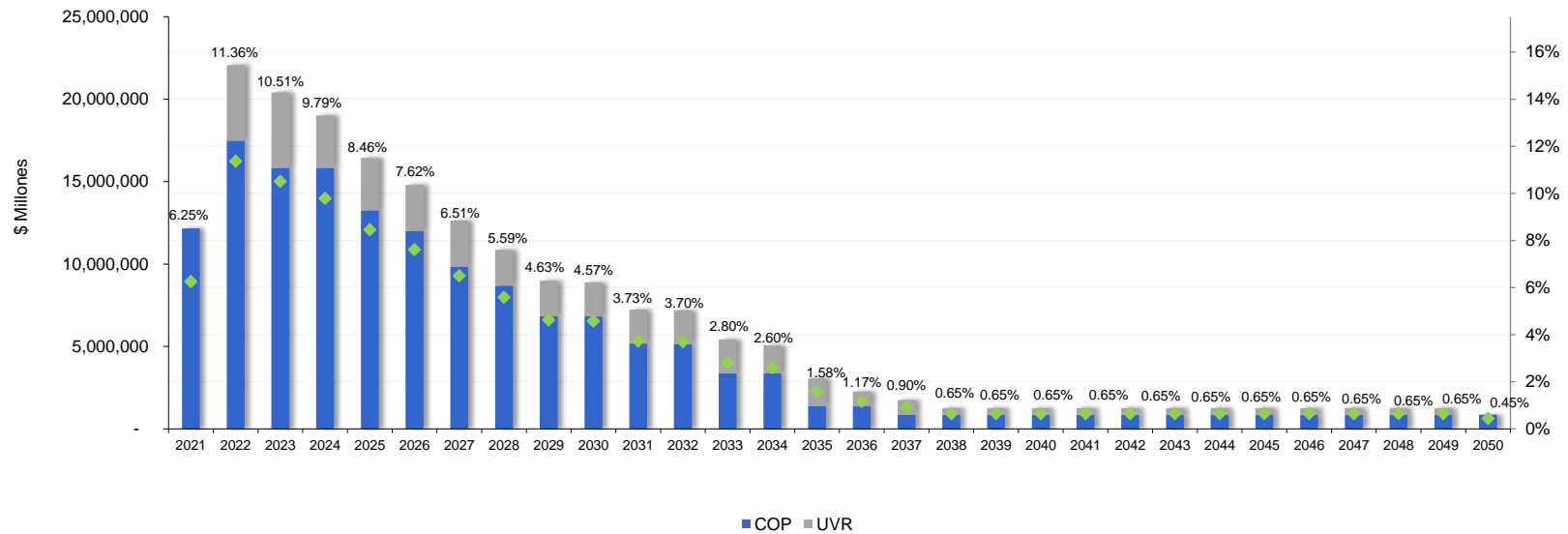
Minhacienda

Perfil de Intereses

Año de Pago	Perfil de Intereses (Millones de Pesos)					
	TES PESOS			TES UVR	TOTAL	Participación
	Descuento	Fija	Total COP			
2021	-	12,151,325	12,151,325	-	12,151,325	6.25%
2022	-	17,484,400	17,484,400	4,585,271	22,069,672	11.36%
2023	-	15,828,263	15,828,263	4,585,271	20,413,534	10.51%
2024	-	15,828,263	15,828,263	3,182,696	19,010,958	9.79%
2025	-	13,250,340	13,250,340	3,182,696	16,433,035	8.46%
2026	-	12,003,288	12,003,288	2,793,344	14,796,632	7.62%
2027	-	9,844,863	9,844,863	2,793,344	12,638,207	6.51%
2028	-	8,687,377	8,687,377	2,171,240	10,858,616	5.59%
2029	-	6,820,408	6,820,408	2,171,240	8,991,648	4.63%
2030	-	6,820,408	6,820,408	2,062,044	8,882,452	4.57%
2031	-	5,178,434	5,178,434	2,062,044	7,240,479	3.73%
2032	-	5,127,460	5,127,460	2,062,044	7,189,504	3.70%
2033	-	3,368,465	3,368,465	2,062,044	5,430,509	2.80%
2034	-	3,368,465	3,368,465	1,691,702	5,060,167	2.60%
2035	-	1,374,332	1,374,332	1,691,702	3,066,035	1.58%
2036	-	1,374,332	1,374,332	890,503	2,264,835	1.17%
2037	-	866,028	866,028	890,503	1,756,530	0.90%
2038	-	866,028	866,028	397,283	1,263,310	0.65%
2039	-	866,028	866,028	397,283	1,263,310	0.65%
2040	-	866,028	866,028	397,283	1,263,310	0.65%
2041	-	866,028	866,028	397,283	1,263,310	0.65%
2042	-	866,028	866,028	397,283	1,263,310	0.65%
2043	-	866,028	866,028	397,283	1,263,310	0.65%
2044	-	866,028	866,028	397,283	1,263,310	0.65%
2045	-	866,028	866,028	397,283	1,263,310	0.65%
2046	-	866,028	866,028	397,283	1,263,310	0.65%
2047	-	866,028	866,028	397,283	1,263,310	0.65%
2048	-	866,028	866,028	397,283	1,263,310	0.65%
2049	-	866,028	866,028	397,283	1,263,310	0.65%
2050	-	866,028	866,028	-	866,028	0.45%
TOTAL	-	150,634,808	150,634,808	43,645,081	194,279,889	100%

Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B

Perfil de Intereses



Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B



El emprendimiento
es de todos

Minhacienda

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			
2021	6,175,399	12,151,325	18,326,724	-	18,326,724	3.23%
2022	4,886,600	41,143,509	46,030,109	4,585,271	50,615,380	8.93%
2023	-	15,828,263	15,828,263	34,113,185	49,941,447	8.81%
2024	-	41,607,490	41,607,490	3,182,696	44,790,186	7.90%
2025	-	33,203,172	33,203,172	14,307,023	47,510,195	8.38%
2026	-	40,782,282	40,782,282	2,793,344	43,575,626	7.69%
2027	-	29,975,068	29,975,068	21,644,989	51,620,057	9.11%
2028	-	39,803,519	39,803,519	2,171,240	41,974,759	7.41%
2029	-	6,820,408	6,820,408	7,024,368	13,844,776	2.44%
2030	-	28,007,168	28,007,168	2,062,044	30,069,213	5.31%
2031	-	5,906,642	5,906,642	2,062,044	7,968,687	1.41%
2032	-	30,255,957	30,255,957	2,062,044	32,318,001	5.70%
2033	-	3,368,465	3,368,465	14,406,783	17,775,248	3.14%
2034	-	30,873,740	30,873,740	1,691,702	32,565,442	5.75%
2035	-	1,374,332	1,374,332	18,559,058	19,933,390	3.52%
2036	-	9,507,209	9,507,209	890,503	10,397,712	1.83%
2037	-	866,028	866,028	14,043,041	14,909,068	2.63%
2038	-	866,028	866,028	397,283	1,263,310	0.22%
2039	-	866,028	866,028	397,283	1,263,310	0.22%
2040	-	866,028	866,028	397,283	1,263,310	0.22%
2041	-	866,028	866,028	397,283	1,263,310	0.22%
2042	-	866,028	866,028	397,283	1,263,310	0.22%
2043	-	866,028	866,028	397,283	1,263,310	0.22%
2044	-	866,028	866,028	397,283	1,263,310	0.22%
2045	-	866,028	866,028	397,283	1,263,310	0.22%
2046	-	866,028	866,028	397,283	1,263,310	0.22%
2047	-	866,028	866,028	397,283	1,263,310	0.22%
2048	-	866,028	866,028	397,283	1,263,310	0.22%
2049	-	866,028	866,028	10,991,487	11,857,515	2.09%
2050	-	12,811,235	12,811,235	-	12,811,235	2.26%
TOTAL	11,061,999	394,678,142	405,740,141	160,960,931	566,701,072	100%

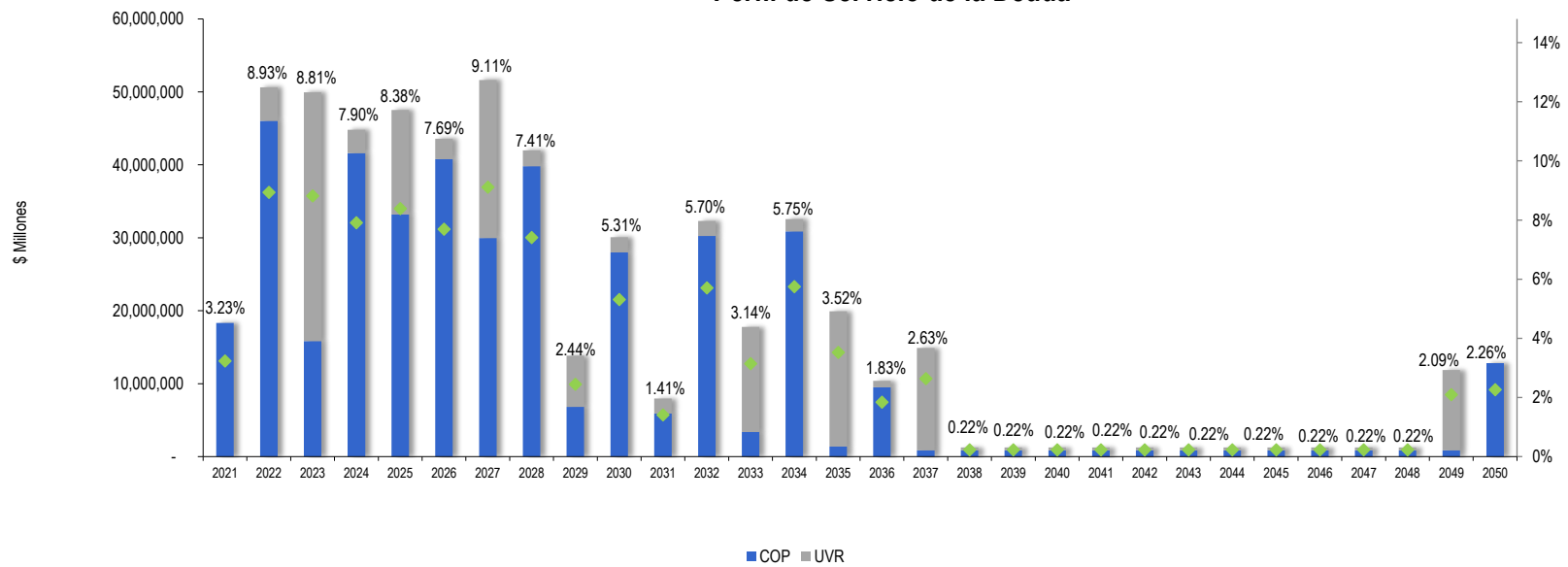
Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B



El emprendimiento
es de todos

Minhacienda

Perfil de Servicio de la Deuda



Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B



El emprendimiento
es de todos

Minhacienda

Tenedores

Grupo / Tenedores	Saldo por Grupo de Tenedores (Millones de Pesos)			
	TES PESOS	TES UVR	Total	Participación
Fondos de Pensiones y Cesantías	46,138,389	58,299,280	104,437,669	28.04%
Fondos de Capital Extranjero ¹	91,799,509	3,984,204	95,783,713	25.72%
Bancos Comerciales	42,109,229	16,347,416	58,456,644	15.70%
Fiducia Publica	25,779,481	9,250,231	35,029,712	9.41%
Compañías de Seguros y Capitalización	5,395,453	16,051,541	21,446,993	5.76%
Instituciones Oficiales Especiales ²	11,321,842	3,906,524	15,228,365	4.09%
Ministerio de Hacienda y CP	9,690,584	2,457,902	12,148,486	3.26%
Banco de la Republica	8,351,759	1,498,236	9,849,995	2.64%
Carteras Colectivas y Fondos Administrados ³	5,982,222	2,320,386	8,302,608	2.23%
Fondos de Prima Media	2,204,509	1,389,851	3,594,360	0.97%
Corporaciones Financieras	2,211,581	386,357	2,597,938	0.70%
Entidades Publicas	1,370,532	476,349	1,846,881	0.50%
Personas Juridicas	901,477	204,162	1,105,638	0.30%
Comisionistas de Bolsa	702,372	233,061	935,433	0.25%
Proveedores de Infraestructura ⁴	409,273	166,863	576,136	0.15%
Administradoras de Carteras Colectivas y de Fdos Pensiones y Cesantías ⁵	256,162	249,298	505,460	0.14%
Entidades sin Animo de Lucro	255,781	77,424	333,205	0.09%
Personas Naturales	116,400	9,969	126,369	0.03%
Otros Fondos ⁶	41,779	6,799	48,578	0.01%
Compañías de Financiamiento Comercial	45,500	-	45,500	0.01%
Cooperativas Grado Super. Caracter Finan	21,500	-	21,500	0.01%
	255,105,333	117,315,850	372,421,183	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.