

Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B



Fecha de Corte : 30-jun-2022
TRM 4,127.47
UVR 309.2286

Indicadores y Composición General

Condiciones Financieras del Portafolio			
Concepto	(Millones de Pesos)		TOTAL
	Denominación		
	TES PESOS	TES UVR	
Valor Nominal	279,260,625	143,078,882	422,339,507
Valor de Mercado	235,124,182	132,034,115	367,158,298
Cupón Promedio	6.949	13.185	9.062
Descuento Promedio	11.111	13.870	12.046
Vida Media	8.762	10.080	9.208
Duración	5.327	7.559	6.083
Duración Modificada	4.783	7.198	5.601
Participación	66.12%	33.88%	100.00%

Análisis Comparativo

Títulos de Tesorería TES						
Evolución del Perfil de Deuda						
(Millones de Pesos)						
Comportamiento Anual y Acumulado						
TOTAL GENERAL	jun-21	jun-22	Variación Anual	dic-21	Var. Acum	Var. Acum %
Valor Nominal	372,421,183	422,339,507	13.40%	397,878,200	24,461,307	6.15%
Valor de Mercado	389,647,511	367,158,298	-5.77%	396,934,555	(29,776,257)	-7.50%
Cupón Promedio	7.006	9.062	29.34%	7.644	142 pb	18.54%
Descuento Promedio	6.084	12.046	97.98%	7.771	427 pb	55.00%
Vida Media	8.363	9.208	10.11%	8.647	0.562	6.49%
Duración	5.998	6.083	1.41%	6.119 -	0.036	-0.60%
Duración Modificada	5.687	5.601	-1.51%	5.761 -	0.160	-2.77%

Variación Anual				Variación Anual			
TES PESOS	jun-21	jun-22	Variación Anual	TES UVR	jun-21	jun-22	Variación Anual
Valor Nominal	255,105,333	279,260,625	9.47%	Valor Nominal	117,315,850	143,078,882	21.96%
Valor de Mercado	267,424,004	235,124,182	-12.08%	Valor de Mercado	122,223,507	132,034,115	8.03%
Cupón Promedio	6.854	6.949	1.39%	Cupón Promedio	7.337	13.185	79.69%
Descuento Promedio	6.094	11.111	82.34%	Descuento Promedio	6.064	13.870	128.72%
Vida Media	7.833	8.762	11.86%	Vida Media	9.516	10.080	5.93%
Duración	5.367	5.327	-0.75%	Duración	7.372	7.559	2.55%
Duración Modificada	5.022	4.783	-4.77%	Duración Modificada	7.132	7.198	0.93%

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	11,095,570	268,165,055	279,260,625	143,078,882	422,339,507
Valor de Mercado	10,647,377	224,476,805	235,124,182	132,034,115	367,158,298
Cupón Promedio	-	7.237	6.949	13.185	9.062
Descuento Promedio	8.548	11.218	11.111	13.870	12.046
Vida Media	0.481	9.104	8.762	10.080	9.208
Duración	0.481	5.527	5.327	7.559	6.083
Duración Modificada	0.441	4.962	4.783	7.198	5.601

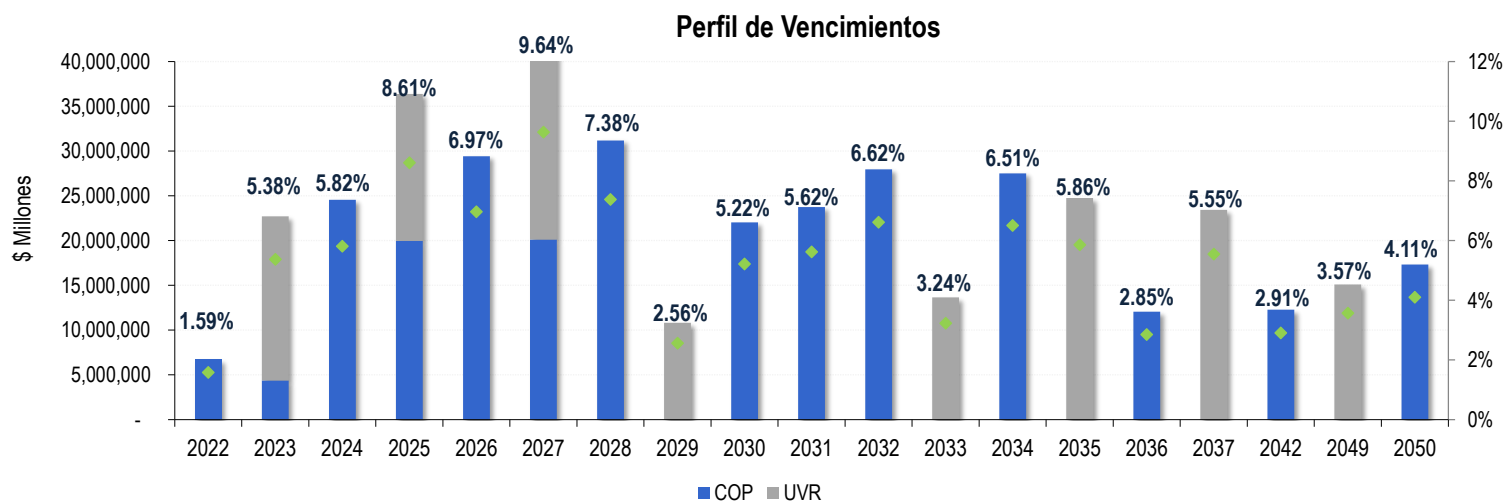
Portafolio por Tipo de Tasa y Denominación en Moneda Original

Concepto	Portafolio de TES por Tipo de Tasa			
	TES PESOS			TES UVR
	Descuento	Fija	Total COP	
Valor Nominal	11,095,570	268,165,055	279,260,625	462,696
Valor de Mercado	10,647,377	224,476,805	235,124,182	426,979
Cupón Promedio	-	7.237	6.949	3.773
Descuento Promedio	8.548	11.218	11.111	4.400
Vida Media	0.481	9.104	8.762	10.080
Duración	0.481	5.527	5.327	7.559
Duración Modificada	0.441	4.962	4.783	7.198

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	6,704,500	-	6,704,500	-	6,704,500	1.59%
2023	4,391,070	-	4,391,070	18,313,838	22,704,908	5.38%
2024	-	24,563,554	24,563,554	-	24,563,554	5.82%
2025	-	19,952,832	19,952,832	16,425,880	36,378,712	8.61%
2026	-	29,419,494	29,419,494	-	29,419,494	6.97%
2027	-	20,130,204	20,130,204	20,577,536	40,707,741	9.64%
2028	-	31,180,975	31,180,975	-	31,180,975	7.38%
2029	-	-	-	10,822,736	10,822,736	2.56%
2030	-	22,037,127	22,037,127	-	22,037,127	5.22%
2031	-	23,747,940	23,747,940	-	23,747,940	5.62%
2032	-	27,953,498	27,953,498	-	27,953,498	6.62%
2033	-	-	-	13,664,652	13,664,652	3.24%
2034	-	27,505,275	27,505,275	-	27,505,275	6.51%
2035	-	-	-	24,754,773	24,754,773	5.86%
2036	-	12,051,017	12,051,017	-	12,051,017	2.85%
2037	-	-	-	23,429,507	23,429,507	5.55%
2042	-	12,285,330	12,285,330	-	12,285,330	2.91%
2049	-	-	-	15,089,961	15,089,961	3.57%
2050	-	17,337,810	17,337,810	-	17,337,810	4.11%
TOTAL	11,095,570	268,165,055	279,260,625	143,078,882	422,339,507	100%



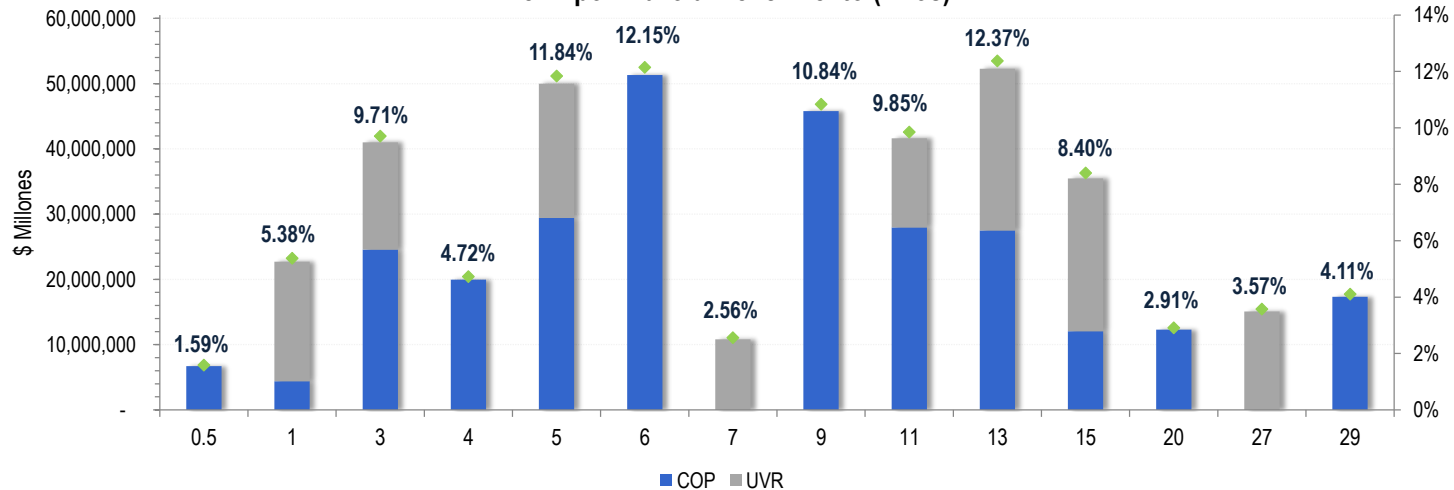
Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B



Portafolio por Plazo al Vencimiento

Plazo al Vencimiento (Años)	Portafolio por Plazo al Vencimiento (Millones de Pesos)			TES UVR	TOTAL	Participacion
	Descuento	Fija	Total COP			
0.5	6,704,500	-	6,704,500	-	6,704,500	1.59%
1	4,391,070	-	4,391,070	18,313,838	22,704,908	5.38%
3	-	24,563,554	24,563,554	16,425,880	40,989,433	9.71%
4	-	19,952,832	19,952,832	-	19,952,832	4.72%
5	-	29,419,494	29,419,494	20,577,536	49,997,030	11.84%
6	-	51,311,179	51,311,179	-	51,311,179	12.15%
7	-	-	-	10,822,736	10,822,736	2.56%
9	-	45,785,067	45,785,067	-	45,785,067	10.84%
11	-	27,953,498	27,953,498	13,664,652	41,618,150	9.85%
13	-	27,505,275	27,505,275	24,754,773	52,260,048	12.37%
15	-	12,051,017	12,051,017	23,429,507	35,480,524	8.40%
20	-	12,285,330	12,285,330	-	12,285,330	2.91%
27	-	-	-	15,089,961	15,089,961	3.57%
29	-	17,337,810	17,337,810	-	17,337,810	4.11%
TOTAL	11,095,570	268,165,055	279,260,625	143,078,882	422,339,507	100%

Perfil por Plazo al Vencimiento (Años)

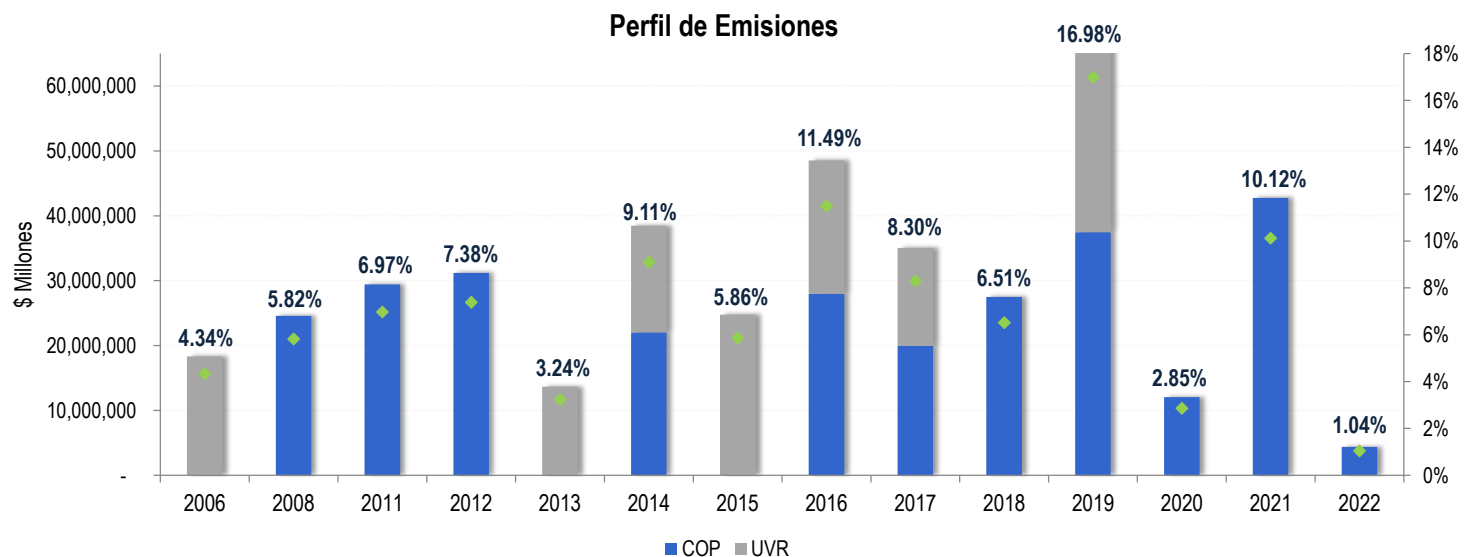


Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B



Portafolio por Año de Emisión

Año Emisión	TES PESOS (Millones de Pesos)			TES UVR	TOTAL	Participación
	Descuento	Fija	Total COP			
2006	-	-	-	18,313,838	18,313,838	4.34%
2008	-	24,563,554	24,563,554	-	24,563,554	5.82%
2011	-	29,419,494	29,419,494	-	29,419,494	6.97%
2012	-	31,180,975	31,180,975	-	31,180,975	7.38%
2013	-	-	-	13,664,652	13,664,652	3.24%
2014	-	22,037,127	22,037,127	16,425,880	38,463,007	9.11%
2015	-	-	-	24,754,773	24,754,773	5.86%
2016	-	27,953,498	27,953,498	20,577,536	48,531,034	11.49%
2017	-	19,952,832	19,952,832	15,089,961	35,042,793	8.30%
2018	-	27,505,275	27,505,275	-	27,505,275	6.51%
2019	-	37,468,014	37,468,014	34,252,243	71,720,257	16.98%
2020	-	12,051,017	12,051,017	-	12,051,017	2.85%
2021	6,704,500	36,033,270	42,737,769	-	42,737,769	10.12%
2022	4,391,070	-	4,391,070	-	4,391,070	1.04%
TOTAL	11,095,570	268,165,055	279,260,625	143,078,882	422,339,507	100%



Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B

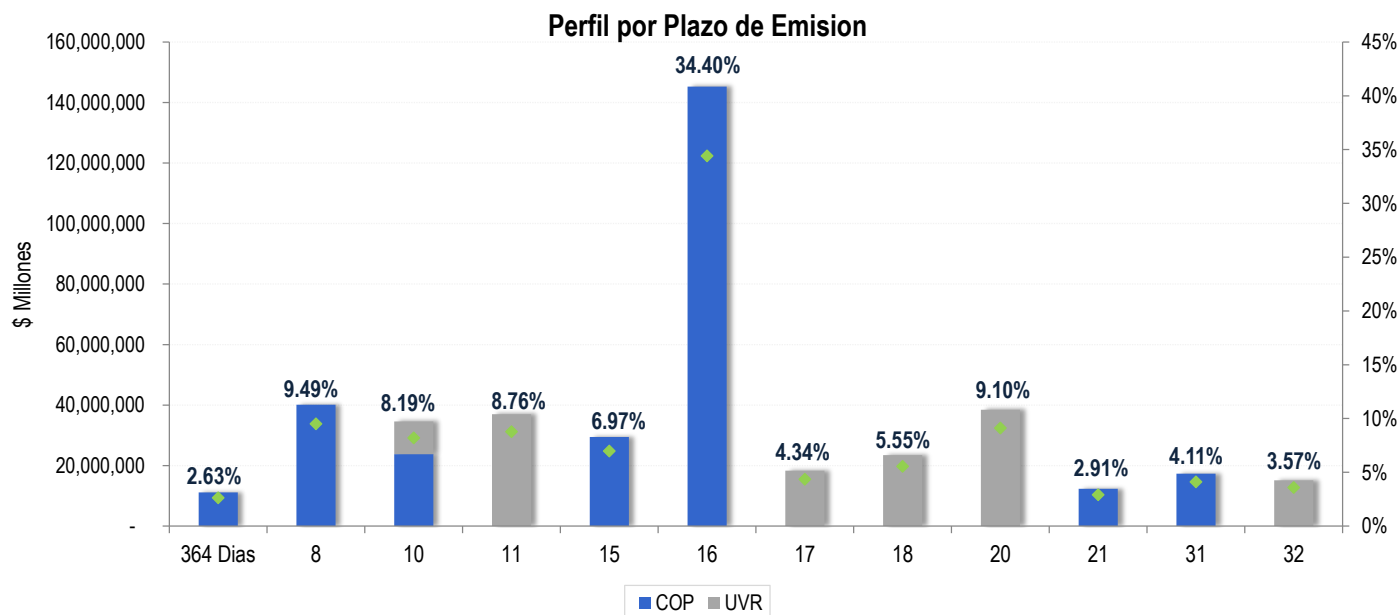


**El emprendimiento
es de todos**

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	11,095,570	-	11,095,570	-	11,095,570	2.63%
8	-	40,083,036	40,083,036	-	40,083,036	9.49%
10	-	23,747,940	23,747,940	10,822,736	34,570,675	8.19%
11	-	-	-	37,003,416	37,003,416	8.76%
15	-	29,419,494	29,419,494	-	29,419,494	6.97%
16	-	145,291,446	145,291,446	-	145,291,446	34.40%
17	-	-	-	18,313,838	18,313,838	4.34%
18	-	-	-	23,429,507	23,429,507	5.55%
20	-	-	-	38,419,425	38,419,425	9.10%
21	-	12,285,330	12,285,330	-	12,285,330	2.91%
31	-	17,337,810	17,337,810	-	17,337,810	4.11%
32	-	-	-	15,089,961	15,089,961	3.57%
TOTAL	11,095,570	268,165,055	279,260,625	143,078,882	422,339,507	100%



Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B



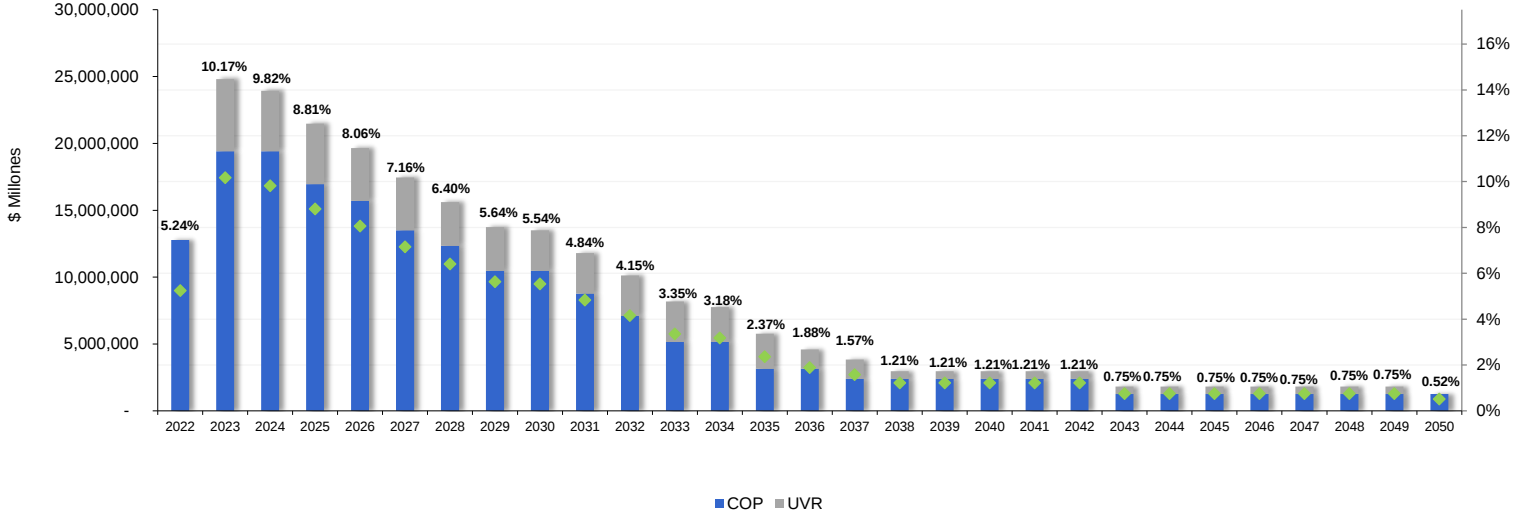
Perfil de Intereses

Año de Pago	Perfil de Intereses (Millones de Pesos)						Participación	
	TES PESOS			TES UVR	TOTAL			
	Descuento	Fija	Total COP					
2022	-	12,779,546	12,779,546	-	12,779,546	5.24%		
2023	-	19,405,898	19,405,898	5,397,655	24,803,553	10.17%		
2024	-	19,405,898	19,405,898	4,527,747	23,933,645	9.82%		
2025	-	16,949,542	16,949,542	4,527,747	21,477,290	8.81%		
2026	-	15,702,490	15,702,490	3,952,842	19,655,332	8.06%		
2027	-	13,496,028	13,496,028	3,952,842	17,448,870	7.16%		
2028	-	12,338,542	12,338,542	3,273,783	15,612,325	6.40%		
2029	-	10,467,683	10,467,683	3,273,783	13,741,466	5.64%		
2030	-	10,467,683	10,467,683	3,030,271	13,497,955	5.54%		
2031	-	8,759,806	8,759,806	3,030,271	11,790,077	4.84%		
2032	-	7,097,450	7,097,450	3,030,271	10,127,721	4.15%		
2033	-	5,140,705	5,140,705	3,030,271	8,170,977	3.35%		
2034	-	5,140,705	5,140,705	2,620,332	7,761,037	3.18%		
2035	-	3,146,573	3,146,573	2,620,332	5,766,905	2.37%		
2036	-	3,146,573	3,146,573	1,444,480	4,591,053	1.88%		
2037	-	2,393,384	2,393,384	1,444,480	3,837,864	1.57%		
2038	-	2,393,384	2,393,384	565,874	2,959,258	1.21%		
2039	-	2,393,384	2,393,384	565,874	2,959,258	1.21%		
2040	-	2,393,384	2,393,384	565,874	2,959,258	1.21%		
2041	-	2,393,384	2,393,384	565,874	2,959,258	1.21%		
2042	-	2,393,384	2,393,384	565,874	2,959,258	1.21%		
2043	-	1,256,991	1,256,991	565,874	1,822,865	0.75%		
2044	-	1,256,991	1,256,991	565,874	1,822,865	0.75%		
2045	-	1,256,991	1,256,991	565,874	1,822,865	0.75%		
2046	-	1,256,991	1,256,991	565,874	1,822,865	0.75%		
2047	-	1,256,991	1,256,991	565,874	1,822,865	0.75%		
2048	-	1,256,991	1,256,991	565,874	1,822,865	0.75%		
2049	-	1,256,991	1,256,991	565,874	1,822,865	0.75%		
2050	-	1,256,991	1,256,991	-	1,256,991	0.52%		
TOTAL	-	187,861,358	187,861,358	55,947,590	243,808,947	100%		

Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B



Perfil de Intereses



Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B



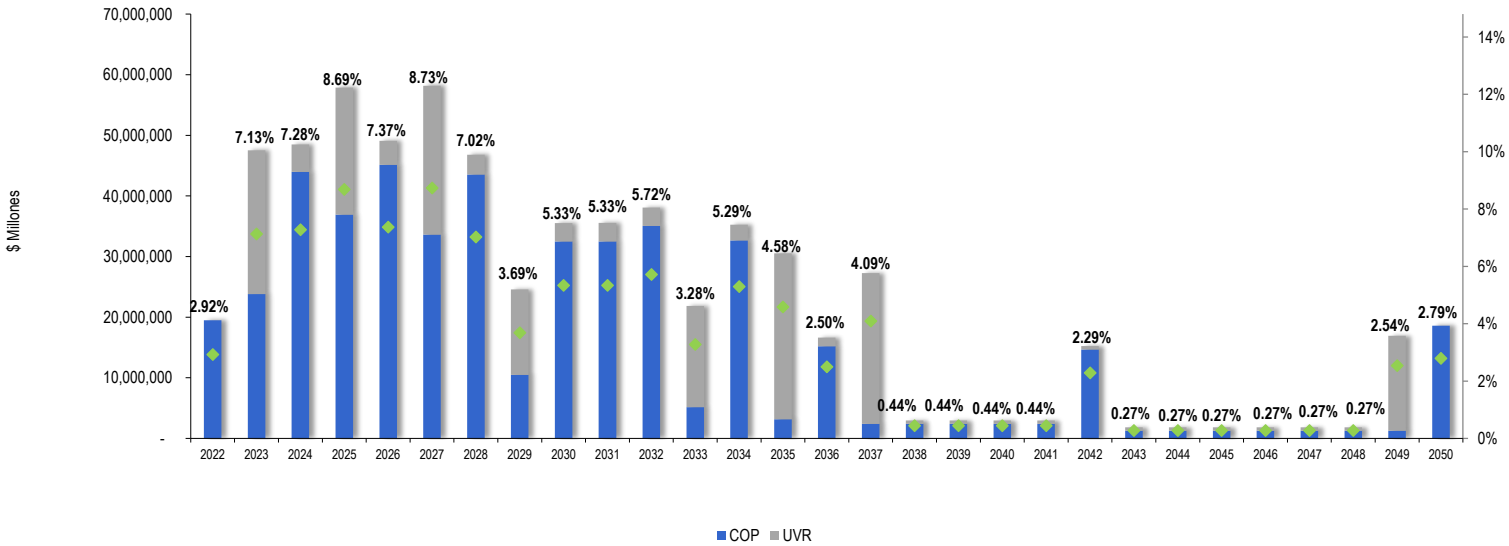
Perfil de Servicio de la Deuda

Año de Pago	Perfil de Servicio de Deuda (Millones de Pesos)			TES UVR	TOTAL	Participación
	TES PESOS					
	Descuento	Fija	Total COP			
2022	6,704,500	12,779,546	19,484,045	-	19,484,045	2.92%
2023	4,391,070	19,405,898	23,796,968	23,711,492	47,508,460	7.13%
2024	-	43,969,452	43,969,452	4,527,747	48,497,199	7.28%
2025	-	36,902,374	36,902,374	20,953,627	57,856,001	8.69%
2026	-	45,121,984	45,121,984	3,952,842	49,074,826	7.37%
2027	-	33,626,233	33,626,233	24,530,378	58,156,611	8.73%
2028	-	43,519,516	43,519,516	3,273,783	46,793,299	7.02%
2029	-	10,467,683	10,467,683	14,096,519	24,564,202	3.69%
2030	-	32,504,811	32,504,811	3,030,271	35,535,082	5.33%
2031	-	32,507,745	32,507,745	3,030,271	35,538,017	5.33%
2032	-	35,050,948	35,050,948	3,030,271	38,081,219	5.72%
2033	-	5,140,705	5,140,705	16,694,924	21,835,629	3.28%
2034	-	32,645,981	32,645,981	2,620,332	35,266,312	5.29%
2035	-	3,146,573	3,146,573	27,375,105	30,521,678	4.58%
2036	-	15,197,590	15,197,590	1,444,480	16,642,070	2.50%
2037	-	2,393,384	2,393,384	24,873,987	27,267,371	4.09%
2038	-	2,393,384	2,393,384	565,874	2,959,258	0.44%
2039	-	2,393,384	2,393,384	565,874	2,959,258	0.44%
2040	-	2,393,384	2,393,384	565,874	2,959,258	0.44%
2041	-	2,393,384	2,393,384	565,874	2,959,258	0.44%
2042	-	14,678,714	14,678,714	565,874	15,244,588	2.29%
2043	-	1,256,991	1,256,991	565,874	1,822,865	0.27%
2044	-	1,256,991	1,256,991	565,874	1,822,865	0.27%
2045	-	1,256,991	1,256,991	565,874	1,822,865	0.27%
2046	-	1,256,991	1,256,991	565,874	1,822,865	0.27%
2047	-	1,256,991	1,256,991	565,874	1,822,865	0.27%
2048	-	1,256,991	1,256,991	565,874	1,822,865	0.27%
2049	-	1,256,991	1,256,991	15,655,834	16,912,826	2.54%
2050	-	18,594,801	18,594,801	-	18,594,801	2.79%
TOTAL	11,095,570	456,026,413	467,121,983	199,026,472	666,148,455	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	48,355,765	67,561,843	115,917,609	27.45%
Fondos de Capital Extranjero ¹	102,907,960	8,142,430	111,050,390	26.29%
Bancos Comerciales	40,927,026	18,139,202	59,066,228	13.99%
Fiducia Publica	27,363,512	10,838,757	38,202,269	9.05%
Banco de la Republica	28,152,530	5,220,634	33,373,164	7.90%
Compañías de Seguros y Capitalizacion	6,910,458	21,653,338	28,563,795	6.76%
Instituciones Oficiales Especiales ²	13,263,378	4,737,961	18,001,338	4.26%
Carteras Colectivas y Fondos Administrados ³	3,050,452	1,468,210	4,518,662	1.07%
Ministerio de Hacienda y CP	1,231,345	2,435,027	3,666,372	0.87%
Fondos de Prima Media	1,599,782	1,403,947	3,003,729	0.71%
Corporaciones Financieras	1,405,982	600,604	2,006,586	0.48%
Personas Juridicas	1,355,003	371,302	1,726,305	0.41%
Entidades Publicas	1,015,698	68,092	1,083,789	0.26%
Proveedores de Infraestructura ⁴	372,333	189,098	561,431	0.13%
Comisionistas de Bolsa	382,472	76,610	459,081	0.11%
Entidades sin Animo de Lucro	385,336	10,823	396,159	0.09%
Administradoras de Carteras Colectivas y de Fdos Pensiones y Cesantías ⁵	248,038	138,225	386,263	0.09%
Personas Naturales	218,538	13,967	232,505	0.06%
Otros Fondos ⁶	71,169	5,721	76,890	0.02%
Compañías de Financiamiento Comercial	38,850	3,092	41,942	0.01%
Cooperativas Grado Super. Caracter Finan	5,000	-	5,000	0.00%
	279,260,625	143,078,882	422,339,507	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.