

Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B



Fecha de Corte : 31-mar-2022
TRM 3,748.15
UVR 298.7784

Indicadores y Composición General

Condiciones Financieras del Portafolio			
Concepto	(Millones de Pesos)		TOTAL
	Denominación		
	TES PESOS	TES UVR	
Valor Nominal	276,006,734	138,871,086	414,877,820
Valor de Mercado	252,763,696	138,435,287	391,198,983
Cupón Promedio	6.878	12.176	8.652
Descuento Promedio	9.259	11.460	9.996
Vida Media	8.442	9.507	8.799
Duración	5.368	7.189	5.977
Duración Modificada	4.897	6.910	5.571
Participación	66.53%	33.47%	100.00%

Análisis Comparativo

Títulos de Tesorería TES						
Evolución del Perfil de Deuda						
(Millones de Pesos)						
Comportamiento Anual y Acumulado						
TOTAL GENERAL	mar-21	mar-22	Variación Anual	dic-21	Var. Acum	Var. Acum %
Valor Nominal	354,208,364	414,877,820	17.13%	397,878,200	16,999,620	4.27%
Valor de Mercado	379,086,239	391,198,983	3.20%	396,934,555	(5,735,572)	-1.44%
Cupón Promedio	6.471	8.652	33.71%	7.644	101 pb	13.18%
Descuento Promedio	5.168	9.996	93.42%	7.771	222 pb	28.62%
Vida Media	8.224	8.799	6.98%	8.647	0.152	1.76%
Duración	5.962	5.977	0.26%	6.119 -	0.142	-2.32%
Duración Modificada	5.667	5.571	-1.69%	5.761 -	0.190	-3.30%

Variación Anual				Variación Anual			
TES PESOS	mar-21	mar-22	Variación Anual	TES UVR	mar-21	mar-22	Variación Anual
Valor Nominal	244,012,341	276,006,734	13.11%	Valor Nominal	110,196,023	138,871,086	26.02%
Valor de Mercado	260,653,246	252,763,696	-3.03%	Valor de Mercado	118,432,993	138,435,287	16.89%
Cupón Promedio	6.885	6.878	-0.10%	Cupón Promedio	5.554	12.176	119.25%
Descuento Promedio	5.763	9.259	60.67%	Descuento Promedio	3.851	11.460	197.61%
Vida Media	7.725	8.442	9.29%	Vida Media	9.330	9.507	1.90%
Duración	5.373	5.368	-0.10%	Duración	7.265	7.189	-1.05%
Duración Modificada	5.040	4.897	-2.85%	Duración Modificada	7.054	6.910	-2.04%

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	11,991,829	264,014,905	276,006,734	138,871,086	414,877,820
Valor de Mercado	11,622,751	241,140,945	252,763,696	138,435,287	391,198,983
Cupón Promedio	-	7.191	6.878	12.176	8.652
Descuento Promedio	6.744	9.373	9.259	11.460	9.996
Vida Media	0.462	8.805	8.442	9.507	8.799
Duración	0.462	5.590	5.368	7.189	5.977
Duración Modificada	0.431	5.099	4.897	6.910	5.571

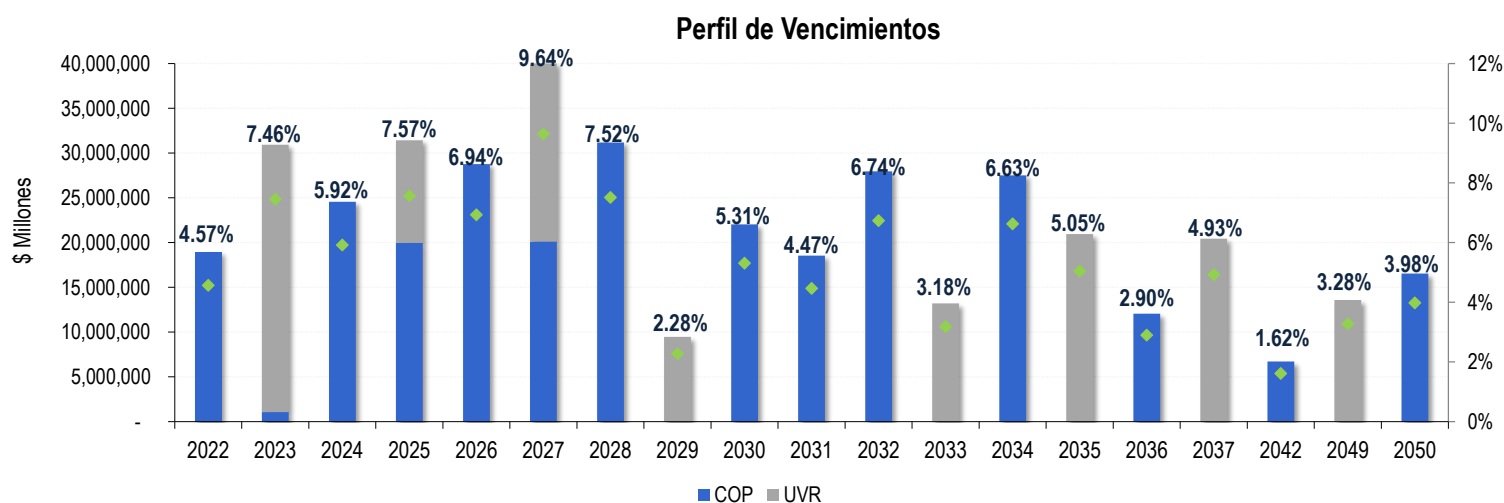
Portafolio por Tipo de Tasa y Denominación en Moneda Original

Concepto	Portafolio de TES por Tipo de Tasa			
	TES PESOS			TES UVR
	Descuento	Fija	Total COP	
Valor Nominal	11,991,829	264,014,905	276,006,734	464,796
Valor de Mercado	11,622,751	241,140,945	252,763,696	463,338
Cupón Promedio	-	7.191	6.878	3.857
Descuento Promedio	6.744	9.373	9.259	3.194
Vida Media	0.462	8.805	8.442	9.507
Duración	0.462	5.590	5.368	7.189
Duración Modificada	0.431	5.099	4.897	6.910

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	10,917,759	8,049,504	18,967,263	-	18,967,263	4.57%
2023	1,074,070	-	1,074,070	29,858,619	30,932,689	7.46%
2024	-	24,563,554	24,563,554	-	24,563,554	5.92%
2025	-	19,952,832	19,952,832	11,467,171	31,420,003	7.57%
2026	-	28,778,994	28,778,994	-	28,778,994	6.94%
2027	-	20,130,204	20,130,204	19,882,130	40,012,335	9.64%
2028	-	31,180,975	31,180,975	-	31,180,975	7.52%
2029	-	-	-	9,464,547	9,464,547	2.28%
2030	-	22,037,127	22,037,127	-	22,037,127	5.31%
2031	-	18,552,176	18,552,176	-	18,552,176	4.47%
2032	-	27,953,498	27,953,498	-	27,953,498	6.74%
2033	-	-	-	13,202,863	13,202,863	3.18%
2034	-	27,505,275	27,505,275	-	27,505,275	6.63%
2035	-	-	-	20,962,540	20,962,540	5.05%
2036	-	12,051,017	12,051,017	-	12,051,017	2.90%
2037	-	-	-	20,433,375	20,433,375	4.93%
2042	-	6,727,110	6,727,110	-	6,727,110	1.62%
2049	-	-	-	13,599,841	13,599,841	3.28%
2050	-	16,532,639	16,532,639	-	16,532,639	3.98%
TOTAL	11,991,829	264,014,905	276,006,734	138,871,086	414,877,820	100%



Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B



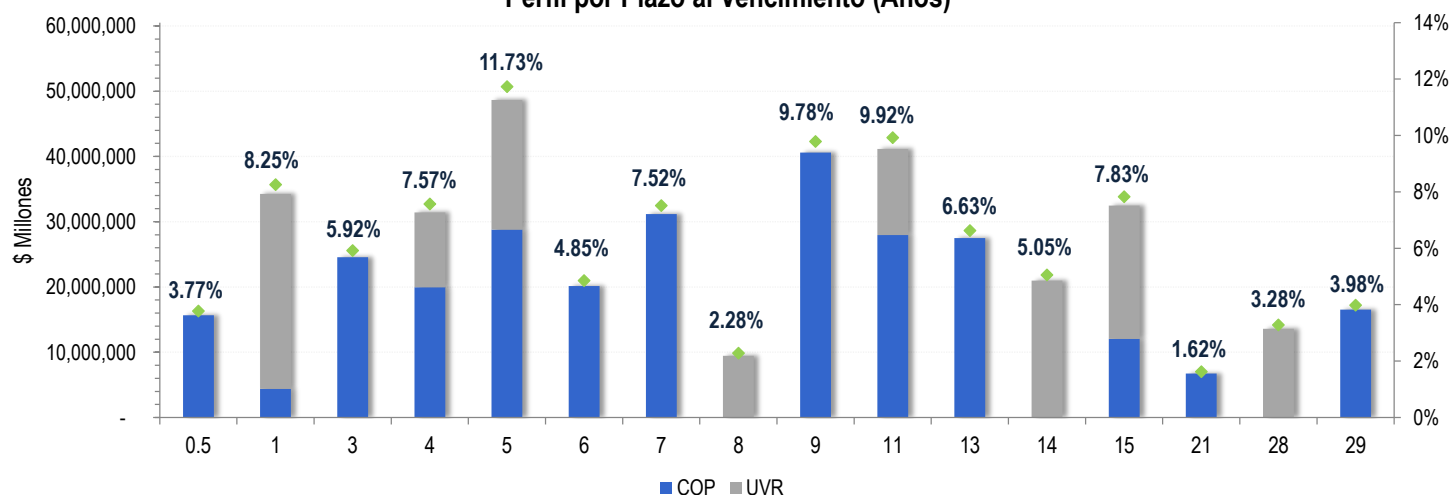
El emprendimiento
es de todos

Minhacienda

Portafolio por Plazo al Vencimiento

Portafolio por Plazo al Vencimiento (Millones de Pesos)						
Plazo al Vencimiento (Años)	TES PESOS			TES UVR	TOTAL	Participacion
	Descuento	Fija	Total COP			
0.5	7,603,759	8,049,504	15,653,264	-	15,653,264	3.77%
1	4,388,070	-	4,388,070	29,858,619	34,246,689	8.25%
3	-	24,563,554	24,563,554	-	24,563,554	5.92%
4	-	19,952,832	19,952,832	11,467,171	31,420,003	7.57%
5	-	28,778,994	28,778,994	19,882,130	48,661,124	11.73%
6	-	20,130,204	20,130,204	-	20,130,204	4.85%
7	-	31,180,975	31,180,975	-	31,180,975	7.52%
8	-	-	-	9,464,547	9,464,547	2.28%
9	-	40,589,303	40,589,303	-	40,589,303	9.78%
11	-	27,953,498	27,953,498	13,202,863	41,156,361	9.92%
13	-	27,505,275	27,505,275	-	27,505,275	6.63%
14	-	-	-	20,962,540	20,962,540	5.05%
15	-	12,051,017	12,051,017	20,433,375	32,484,392	7.83%
21	-	6,727,110	6,727,110	-	6,727,110	1.62%
28	-	-	-	13,599,841	13,599,841	3.28%
29	-	16,532,639	16,532,639	-	16,532,639	3.98%
TOTAL	11,991,829	264,014,905	276,006,734	138,871,086	414,877,820	100%

Perfil por Plazo al Vencimiento (Años)

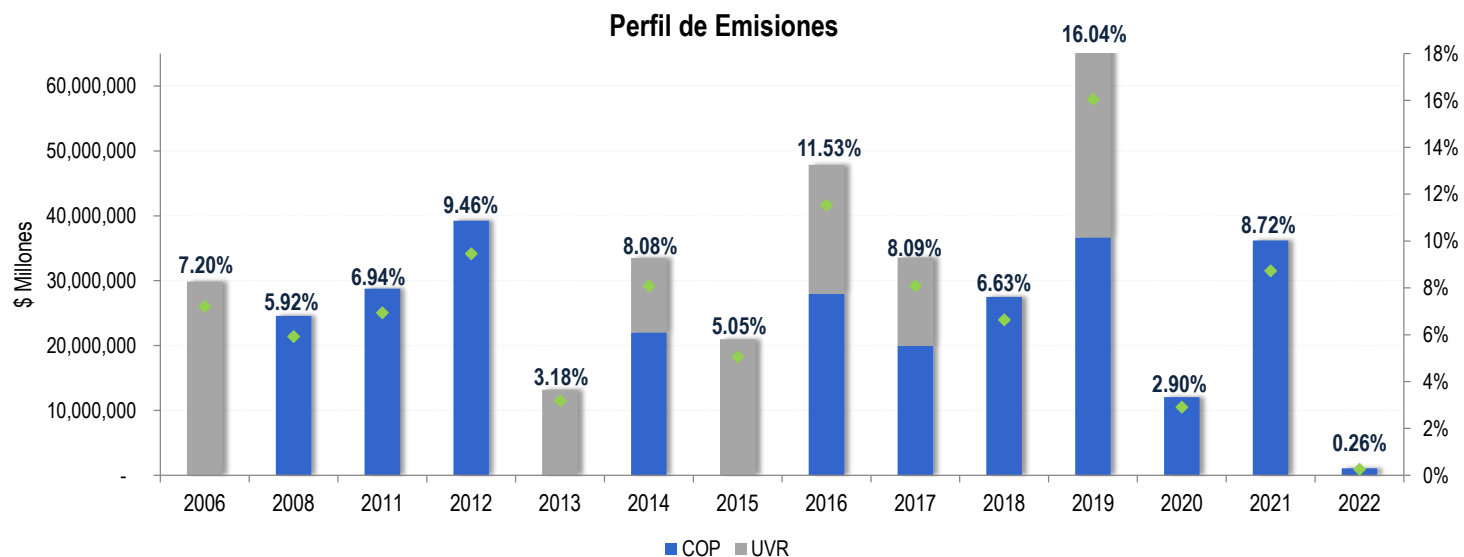


Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B



Portafolio por Año de Emisión

Año Emisión	TES PESOS (Millones de Pesos)			TES UVR	TOTAL	Participacion
	Descuento	Fija	Total COP			
2006	-	-	-	29,858,619	29,858,619	7.20%
2008	-	24,563,554	24,563,554	-	24,563,554	5.92%
2011	-	28,778,994	28,778,994	-	28,778,994	6.94%
2012	-	39,230,479	39,230,479	-	39,230,479	9.46%
2013	-	-	-	13,202,863	13,202,863	3.18%
2014	-	22,037,127	22,037,127	11,467,171	33,504,299	8.08%
2015	-	-	-	20,962,540	20,962,540	5.05%
2016	-	27,953,498	27,953,498	19,882,130	47,835,628	11.53%
2017	-	19,952,832	19,952,832	13,599,841	33,552,673	8.09%
2018	-	27,505,275	27,505,275	-	27,505,275	6.63%
2019	-	36,662,843	36,662,843	29,897,921	66,560,765	16.04%
2020	-	12,051,017	12,051,017	-	12,051,017	2.90%
2021	10,917,759	25,279,286	36,197,045	-	36,197,045	8.72%
2022	1,074,070	-	1,074,070	-	1,074,070	0.26%
TOTAL	11,991,829	264,014,905	276,006,734	138,871,086	414,877,820	100%



Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B

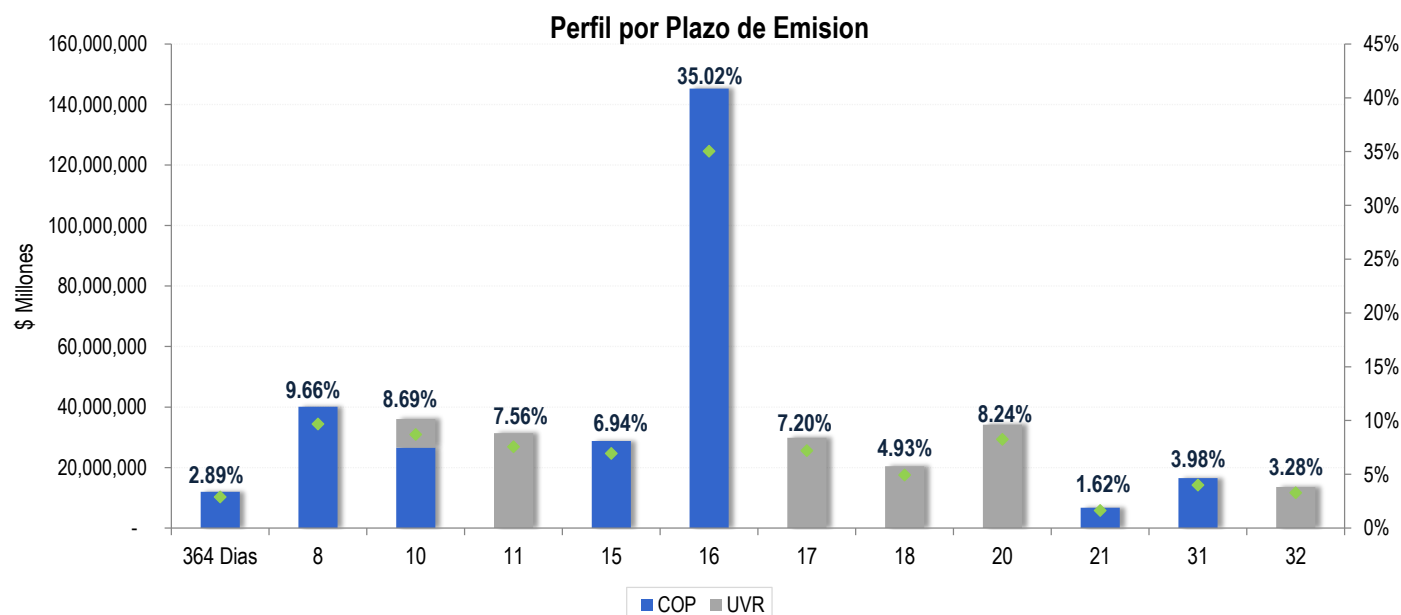


**El emprendimiento
es de todos**

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	11,991,829	-	11,991,829	-	11,991,829	2.89%
8	-	40,083,036	40,083,036	-	40,083,036	9.66%
10	-	26,601,680	26,601,680	9,464,547	36,066,227	8.69%
11	-	-	-	31,349,302	31,349,302	7.56%
15	-	28,778,994	28,778,994	-	28,778,994	6.94%
16	-	145,291,446	145,291,446	-	145,291,446	35.02%
17	-	-	-	29,858,619	29,858,619	7.20%
18	-	-	-	20,433,375	20,433,375	4.93%
20	-	-	-	34,165,403	34,165,403	8.24%
21	-	6,727,110	6,727,110	-	6,727,110	1.62%
31	-	16,532,639	16,532,639	-	16,532,639	3.98%
32	-	-	-	13,599,841	13,599,841	3.28%
TOTAL	11,991,829	264,014,905	276,006,734	138,871,086	414,877,820	100%



Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B

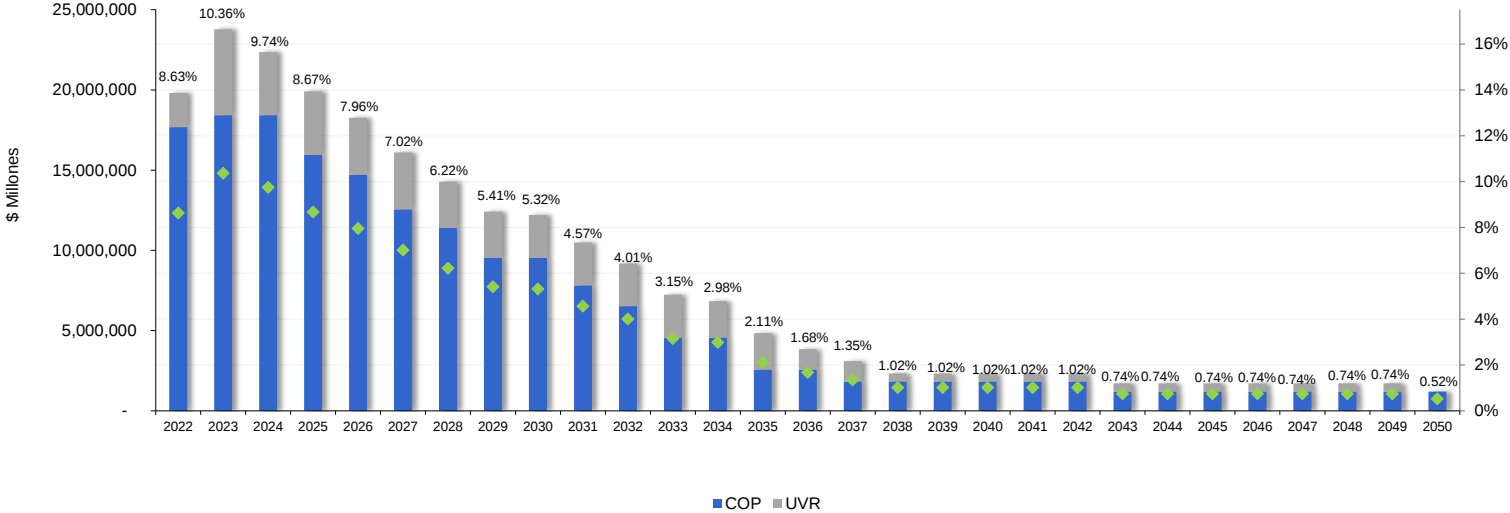


Perfil de Intereses

Año de Pago	Perfil de Intereses (Millones de Pesos)					
	TES PESOS			TES UVR	TOTAL	Participación
	Descuento	Fija	Total COP			
2022	-	17,686,460	17,686,460	2,120,018	19,806,478	8.63%
2023	-	18,421,647	18,421,647	5,356,750	23,778,397	10.36%
2024	-	18,421,647	18,421,647	3,938,466	22,360,112	9.74%
2025	-	15,965,291	15,965,291	3,938,466	19,903,757	8.67%
2026	-	14,718,239	14,718,239	3,537,115	18,255,354	7.96%
2027	-	12,559,815	12,559,815	3,537,115	16,096,929	7.02%
2028	-	11,402,328	11,402,328	2,881,004	14,283,332	6.22%
2029	-	9,531,470	9,531,470	2,881,004	12,412,474	5.41%
2030	-	9,531,470	9,531,470	2,668,052	12,199,522	5.32%
2031	-	7,823,592	7,823,592	2,668,052	10,491,644	4.57%
2032	-	6,524,940	6,524,940	2,668,052	9,192,992	4.01%
2033	-	4,568,195	4,568,195	2,668,052	7,236,247	3.15%
2034	-	4,568,195	4,568,195	2,271,966	6,840,161	2.98%
2035	-	2,574,063	2,574,063	2,271,966	4,846,029	2.11%
2036	-	2,574,063	2,574,063	1,276,246	3,850,308	1.68%
2037	-	1,820,874	1,820,874	1,276,246	3,097,120	1.35%
2038	-	1,820,874	1,820,874	509,994	2,330,868	1.02%
2039	-	1,820,874	1,820,874	509,994	2,330,868	1.02%
2040	-	1,820,874	1,820,874	509,994	2,330,868	1.02%
2041	-	1,820,874	1,820,874	509,994	2,330,868	1.02%
2042	-	1,820,874	1,820,874	509,994	2,330,868	1.02%
2043	-	1,198,616	1,198,616	509,994	1,708,610	0.74%
2044	-	1,198,616	1,198,616	509,994	1,708,610	0.74%
2045	-	1,198,616	1,198,616	509,994	1,708,610	0.74%
2046	-	1,198,616	1,198,616	509,994	1,708,610	0.74%
2047	-	1,198,616	1,198,616	509,994	1,708,610	0.74%
2048	-	1,198,616	1,198,616	509,994	1,708,610	0.74%
2049	-	1,198,616	1,198,616	509,994	1,708,610	0.74%
2050	-	1,198,616	1,198,616	-	1,198,616	0.52%
TOTAL	-	177,385,587	177,385,587	52,078,498	229,464,085	100%

Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B

Perfil de Intereses



Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B



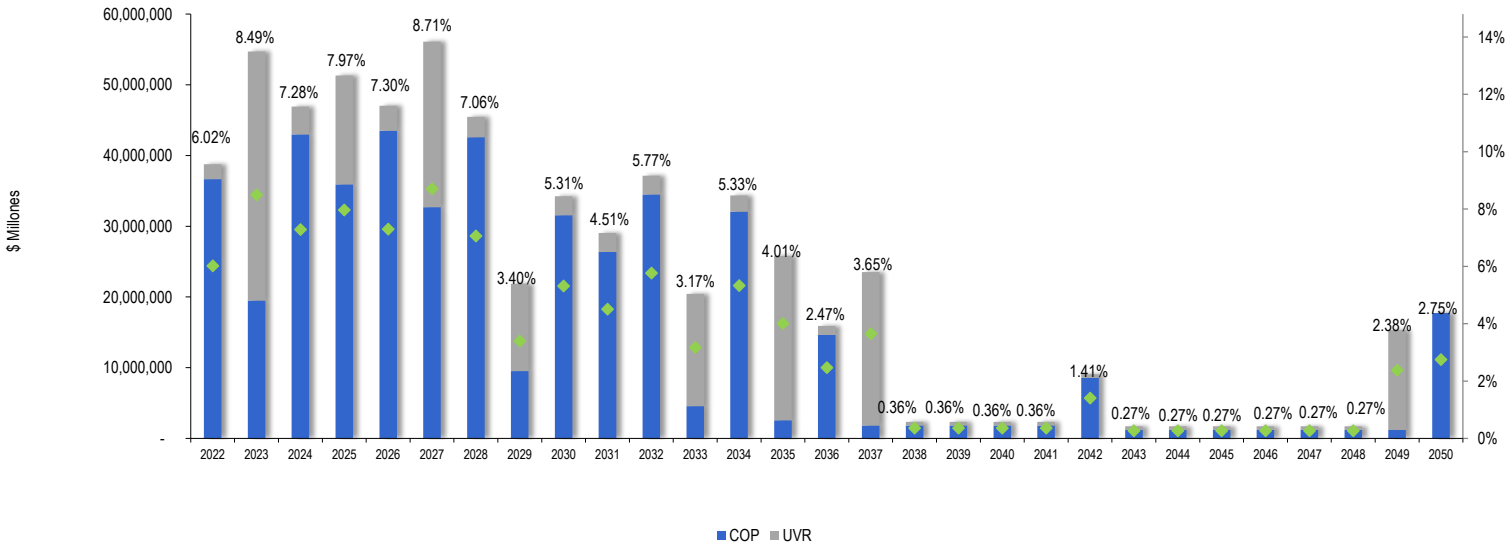
Perfil de Servicio de la Deuda

Año de Pago	Perfil de Servicio de Deuda (Millones de Pesos)					
	TES PESOS			TES UVR	TOTAL	Participación
	Descuento	Fija	Total COP			
2022	10,917,759	25,735,964	36,653,723	2,120,018	38,773,741	6.02%
2023	1,074,070	18,421,647	19,495,717	35,215,369	54,711,085	8.49%
2024	-	42,985,200	42,985,200	3,938,466	46,923,666	7.28%
2025	-	35,918,123	35,918,123	15,405,637	51,323,760	7.97%
2026	-	43,497,233	43,497,233	3,537,115	47,034,348	7.30%
2027	-	32,690,019	32,690,019	23,419,245	56,109,264	8.71%
2028	-	42,583,303	42,583,303	2,881,004	45,464,307	7.06%
2029	-	9,531,470	9,531,470	12,345,551	21,877,021	3.40%
2030	-	31,568,597	31,568,597	2,668,052	34,236,649	5.31%
2031	-	26,375,768	26,375,768	2,668,052	29,043,820	4.51%
2032	-	34,478,437	34,478,437	2,668,052	37,146,489	5.77%
2033	-	4,568,195	4,568,195	15,870,915	20,439,110	3.17%
2034	-	32,073,470	32,073,470	2,271,966	34,345,437	5.33%
2035	-	2,574,063	2,574,063	23,234,506	25,808,568	4.01%
2036	-	14,625,080	14,625,080	1,276,246	15,901,325	2.47%
2037	-	1,820,874	1,820,874	21,709,620	23,530,494	3.65%
2038	-	1,820,874	1,820,874	509,994	2,330,868	0.36%
2039	-	1,820,874	1,820,874	509,994	2,330,868	0.36%
2040	-	1,820,874	1,820,874	509,994	2,330,868	0.36%
2041	-	1,820,874	1,820,874	509,994	2,330,868	0.36%
2042	-	8,547,984	8,547,984	509,994	9,057,978	1.41%
2043	-	1,198,616	1,198,616	509,994	1,708,610	0.27%
2044	-	1,198,616	1,198,616	509,994	1,708,610	0.27%
2045	-	1,198,616	1,198,616	509,994	1,708,610	0.27%
2046	-	1,198,616	1,198,616	509,994	1,708,610	0.27%
2047	-	1,198,616	1,198,616	509,994	1,708,610	0.27%
2048	-	1,198,616	1,198,616	509,994	1,708,610	0.27%
2049	-	1,198,616	1,198,616	14,109,835	15,308,451	2.38%
2050	-	17,731,255	17,731,255	-	17,731,255	2.75%
TOTAL	11,991,829	441,400,491	453,392,320	190,949,584	644,341,905	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	47,693,553	66,103,115	113,796,668	27.43%
Fondos de Capital Extranjero ¹	97,908,756	5,499,710	103,408,466	24.93%
Bancos Comerciales	44,669,903	17,106,888	61,776,792	14.89%
Fiducia Publica	27,876,290	10,457,751	38,334,041	9.24%
Banco de la Republica	26,100,503	4,924,694	31,025,197	7.48%
Compañías de Seguros y Capitalizacion	6,584,125	19,639,812	26,223,936	6.32%
Instituciones Oficiales Especiales ²	13,265,004	4,416,085	17,681,090	4.26%
Ministerio de Hacienda y CP	1,378,724	5,439,084	6,817,808	1.64%
Carteras Colectivas y Fondos Administrados ³	3,395,740	2,182,481	5,578,221	1.34%
Fondos de Prima Media	1,588,509	1,371,441	2,959,949	0.71%
Corporaciones Financieras	1,311,102	656,920	1,968,022	0.47%
Personas Juridicas	1,205,602	296,551	1,502,154	0.36%
Entidades Publicas	1,024,805	32,151	1,056,956	0.25%
Proveedores de Infraestructura ⁴	493,549	175,985	669,534	0.16%
Comisionistas de Bolsa	424,162	185,311	609,473	0.15%
Administradoras de Carteras Colectivas y de Fdos Pensiones y Cesantías ⁵	275,538	287,425	562,963	0.14%
Entidades sin Animo de Lucro	471,076	62,773	533,849	0.13%
Personas Naturales	213,174	18,597	231,771	0.06%
Otros Fondos ⁶	74,119	11,324	85,443	0.02%
Compañías de Financiamiento Comercial	49,500	2,988	52,488	0.01%
Cooperativas Grado Super. Caracter Finan	3,000	-	3,000	0.00%
	276,006,734	138,871,086	414,877,820	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.