

Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B



Fecha de Corte : 31-may-2022
TRM 3,912.34
UVR 306.0926

Indicadores y Composición General

Condiciones Financieras del Portafolio			
Concepto	(Millones de Pesos)		TOTAL
	Denominación TES PESOS	TES UVR	
Valor Nominal	276,748,094	141,282,081	418,030,175
Valor de Mercado	242,847,226	132,080,852	374,928,077
Cupón Promedio	6.849	13.374	9.054
Descuento Promedio	10.241	13.681	11.404
Vida Media	8.620	9.952	9.070
Duración	5.333	7.423	6.039
Duración Modificada	4.824	7.079	5.586
Participación	66.20%	33.80%	100.00%

Análisis Comparativo

Títulos de Tesorería TES Evolución del Perfil de Deuda (Millones de Pesos)						
Comportamiento Anual y Acumulado						
TOTAL GENERAL	may-21	may-22	Variación Anual	dic-21	Var. Acum	Var. Acum %
Valor Nominal	368,368,707	418,030,175	13.48%	397,878,200	20,151,975	5.06%
Valor de Mercado	387,063,323	374,928,077	-3.14%	396,934,555	(22,006,478)	-5.54%
Cupón Promedio	6.537	9.054	38.50%	7.644	141 pb	18.45%
Descuento Promedio	5.476	11.404	108.25%	7.771	363 pb	46.74%
Vida Media	8.288	9.070	9.44%	8.647	0.423	4.90%
Duración	5.916	6.039	2.08%	6.119 -	0.080	-1.31%
Duración Modificada	5.612	5.586	-0.46%	5.761 -	0.174	-3.03%

Variación Anual				Variación Anual			
TES PESOS	may-21	may-22	Variación Anual	TES UVR	abr-21	may-21	Variación Anual
Valor Nominal	253,586,009	276,748,094	9.13%	Valor Nominal	112,229,871	114,782,698	2.27%
Valor de Mercado	266,053,055	242,847,226	-8.72%	Valor de Mercado	118,603,601	121,010,268	2.03%
Cupón Promedio	6.807	6.849	0.62%	Cupón Promedio	5.496	5.942	8.12%
Descuento Promedio	5.988	10.241	71.03%	Descuento Promedio	3.950	4.345	9.98%
Vida Media	7.753	8.620	11.18%	Vida Media	9.393	9.470	0.81%
Duración	5.282	5.333	0.95%	Duración	7.316	7.317	0.01%
Duración Modificada	4.943	4.824	-2.40%	Duración Modificada	7.091	7.090	-0.01%

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	14,308,829	262,439,264	276,748,094	141,282,081	418,030,175
Valor de Mercado	13,897,507	228,949,719	242,847,226	132,080,852	374,928,077
Cupón Promedio	-	7.222	6.849	13.374	9.054
Descuento Promedio	7.403	10.396	10.241	13.681	11.404
Vida Media	0.371	9.070	8.620	9.952	9.070
Duración	0.371	5.603	5.333	7.423	6.039
Duración Modificada	0.343	5.069	4.824	7.079	5.586

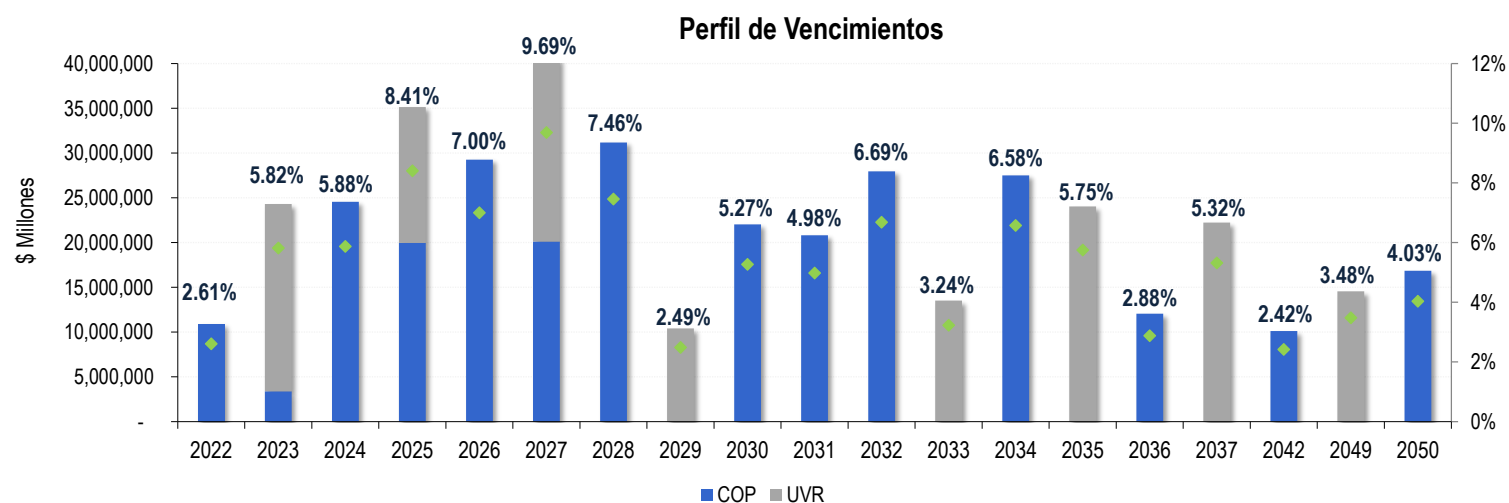
Portafolio por Tipo de Tasa y Denominación en Moneda Original

Concepto	Portafolio de TES por Tipo de Tasa			
	TES PESOS			TES UVR
	Descuento	Fija	Total COP	
Valor Nominal	14,308,829	262,439,264	276,748,094	461,566
Valor de Mercado	13,897,507	228,949,719	242,847,226	431,506
Cupón Promedio	-	7.222	6.849	3.794
Descuento Promedio	7.403	10.396	10.241	4.075
Vida Media	0.371	9.070	8.620	9.952
Duración	0.371	5.603	5.333	7.423
Duración Modificada	0.343	5.069	4.824	7.079

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 PESOS			TES UVR	TOTAL	Participación
	Descuento	Fija	Total COP			
2022	10,917,759	-	10,917,759	-	10,917,759	2.61%
2023	3,391,070	-	3,391,070	20,929,345	24,320,415	5.82%
2024	-	24,563,554	24,563,554	-	24,563,554	5.88%
2025	-	19,952,832	19,952,832	15,200,218	35,153,050	8.41%
2026	-	29,259,494	29,259,494	-	29,259,494	7.00%
2027	-	20,130,204	20,130,204	20,368,852	40,499,056	9.69%
2028	-	31,180,975	31,180,975	-	31,180,975	7.46%
2029	-	-	-	10,407,863	10,407,863	2.49%
2030	-	22,037,127	22,037,127	-	22,037,127	5.27%
2031	-	20,825,281	20,825,281	-	20,825,281	4.98%
2032	-	27,953,498	27,953,498	-	27,953,498	6.69%
2033	-	-	-	13,526,074	13,526,074	3.24%
2034	-	27,505,275	27,505,275	-	27,505,275	6.58%
2035	-	-	-	24,049,178	24,049,178	5.75%
2036	-	12,051,017	12,051,017	-	12,051,017	2.88%
2037	-	-	-	22,242,632	22,242,632	5.32%
2042	-	10,115,889	10,115,889	-	10,115,889	2.42%
2049	-	-	-	14,557,918	14,557,918	3.48%
2050	-	16,864,119	16,864,119	-	16,864,119	4.03%
TOTAL	14.308.829	262.439.264	276.748.094	141.282.081	418.030.175	100%

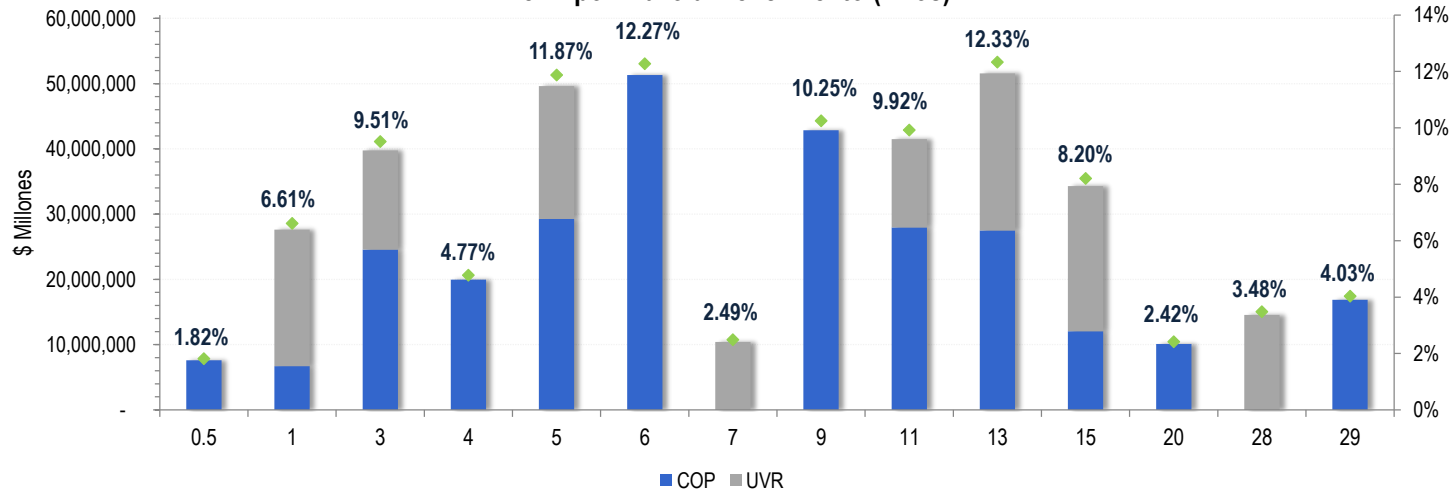


Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B

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	7,603,759	-	7,603,759	-	7,603,759	1.82%
1	6,705,070	-	6,705,070	20,929,345	27,634,415	6.61%
3	-	24,563,554	24,563,554	15,200,218	39,763,772	9.51%
4	-	19,952,832	19,952,832	-	19,952,832	4.77%
5	-	29,259,494	29,259,494	20,368,852	49,628,346	11.87%
6	-	51,311,179	51,311,179	-	51,311,179	12.27%
7	-	-	-	10,407,863	10,407,863	2.49%
9	-	42,862,409	42,862,409	-	42,862,409	10.25%
11	-	27,953,498	27,953,498	13,526,074	41,479,572	9.92%
13	-	27,505,275	27,505,275	24,049,178	51,554,454	12.33%
15	-	12,051,017	12,051,017	22,242,632	34,293,649	8.20%
20	-	10,115,889	10,115,889	-	10,115,889	2.42%
28	-	-	-	14,557,918	14,557,918	3.48%
29	-	16,864,119	16,864,119	-	16,864,119	4.03%
TOTAL	14,308,829	262,439,264	276,748,094	141,282,081	418,030,175	100%

Perfil por Plazo al Vencimiento (Años)

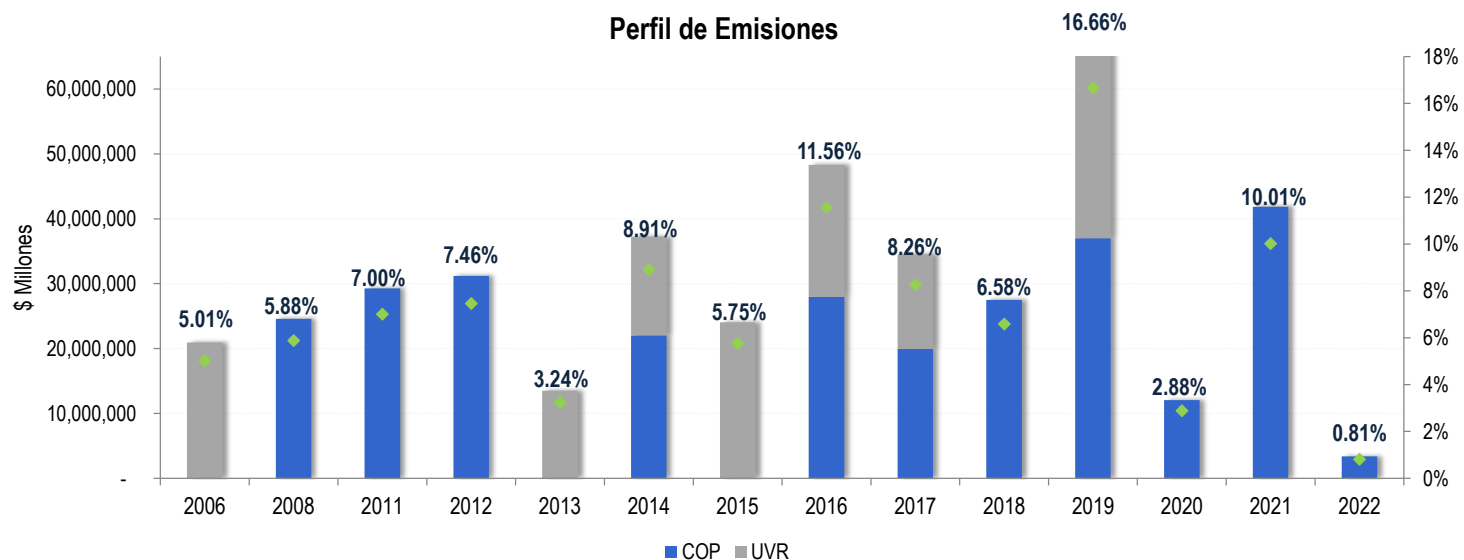


Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B



Portafolio por Año de Emisión

Año Emisión	TES PESOS (Millones de Pesos)			TES UVR	TOTAL	Participación
	Descuento	Fija	Total COP			
2006	-	-	-	20,929,345	20,929,345	5.01%
2008	-	24,563,554	24,563,554	-	24,563,554	5.88%
2011	-	29,259,494	29,259,494	-	29,259,494	7.00%
2012	-	31,180,975	31,180,975	-	31,180,975	7.46%
2013	-	-	-	13,526,074	13,526,074	3.24%
2014	-	22,037,127	22,037,127	15,200,218	37,237,346	8.91%
2015	-	-	-	24,049,178	24,049,178	5.75%
2016	-	27,953,498	27,953,498	20,368,852	48,322,349	11.56%
2017	-	19,952,832	19,952,832	14,557,918	34,510,750	8.26%
2018	-	27,505,275	27,505,275	-	27,505,275	6.58%
2019	-	36,994,323	36,994,323	32,650,495	69,644,818	16.66%
2020	-	12,051,017	12,051,017	-	12,051,017	2.88%
2021	10,917,759	30,941,170	41,858,929	-	41,858,929	10.01%
2022	3,391,070	-	3,391,070	-	3,391,070	0.81%
TOTAL	14,308,829	262,439,264	276,748,094	141,282,081	418,030,175	100%



Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B

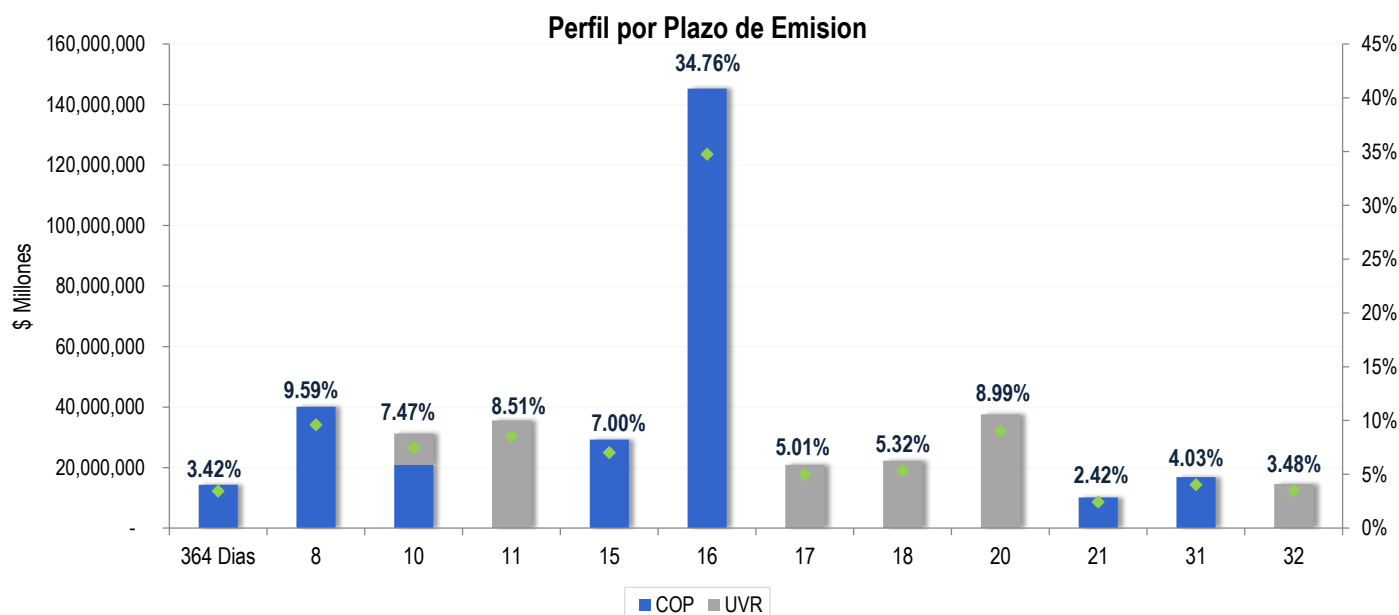


**El emprendimiento
es de todos**

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	14,308,829	-	14,308,829	-	14,308,829	3.42%
8	-	40,083,036	40,083,036	-	40,083,036	9.59%
10	-	20,825,281	20,825,281	10,407,863	31,233,145	7.47%
11	-	-	-	35,569,070	35,569,070	8.51%
15	-	29,259,494	29,259,494	-	29,259,494	7.00%
16	-	145,291,446	145,291,446	-	145,291,446	34.76%
17	-	-	-	20,929,345	20,929,345	5.01%
18	-	-	-	22,242,632	22,242,632	5.32%
20	-	-	-	37,575,252	37,575,252	8.99%
21	-	10,115,889	10,115,889	-	10,115,889	2.42%
31	-	16,864,119	16,864,119	-	16,864,119	4.03%
32	-	-	-	14,557,918	14,557,918	3.48%
TOTAL	14,308,829	262,439,264	276,748,094	141,282,081	418,030,175	100%



Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B

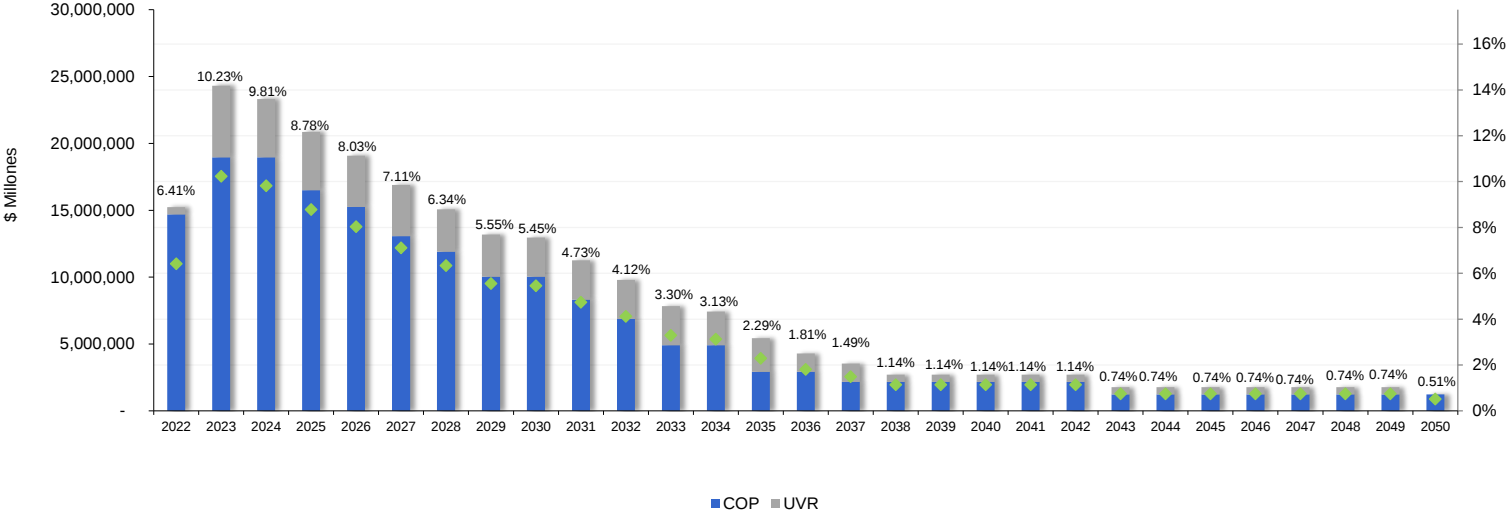


Perfil de Intereses

Año de Pago	Perfil de Intereses (Millones de Pesos)					
	TES PESOS			TES UVR	TOTAL	Participación
	Descuento	Fija	Total COP			
2022	-	14,689,948	14,689,948	545,922	15,235,870	6.41%
2023	-	18,954,296	18,954,296	5,360,639	24,314,935	10.23%
2024	-	18,954,296	18,954,296	4,366,495	23,320,791	9.81%
2025	-	16,497,940	16,497,940	4,366,495	20,864,436	8.78%
2026	-	15,250,888	15,250,888	3,834,488	19,085,376	8.03%
2027	-	13,056,426	13,056,426	3,834,488	16,890,914	7.11%
2028	-	11,898,940	11,898,940	3,162,316	15,061,255	6.34%
2029	-	10,028,081	10,028,081	3,162,316	13,190,397	5.55%
2030	-	10,028,081	10,028,081	2,928,139	12,956,220	5.45%
2031	-	8,320,204	8,320,204	2,928,139	11,248,343	4.73%
2032	-	6,862,434	6,862,434	2,928,139	9,790,573	4.12%
2033	-	4,905,689	4,905,689	2,928,139	7,833,828	3.30%
2034	-	4,905,689	4,905,689	2,522,357	7,428,046	3.13%
2035	-	2,911,557	2,911,557	2,522,357	5,433,913	2.29%
2036	-	2,911,557	2,911,557	1,380,021	4,291,577	1.81%
2037	-	2,158,368	2,158,368	1,380,021	3,538,389	1.49%
2038	-	2,158,368	2,158,368	545,922	2,704,290	1.14%
2039	-	2,158,368	2,158,368	545,922	2,704,290	1.14%
2040	-	2,158,368	2,158,368	545,922	2,704,290	1.14%
2041	-	2,158,368	2,158,368	545,922	2,704,290	1.14%
2042	-	2,158,368	2,158,368	545,922	2,704,290	1.14%
2043	-	1,222,649	1,222,649	545,922	1,768,571	0.74%
2044	-	1,222,649	1,222,649	545,922	1,768,571	0.74%
2045	-	1,222,649	1,222,649	545,922	1,768,571	0.74%
2046	-	1,222,649	1,222,649	545,922	1,768,571	0.74%
2047	-	1,222,649	1,222,649	545,922	1,768,571	0.74%
2048	-	1,222,649	1,222,649	545,922	1,768,571	0.74%
2049	-	1,222,649	1,222,649	545,922	1,768,571	0.74%
2050	-	1,222,649	1,222,649	-	1,222,649	0.51%
TOTAL	-	182,907,426	182,907,426	54,701,532	237,608,958	100%

Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B

Perfil de Intereses



Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B



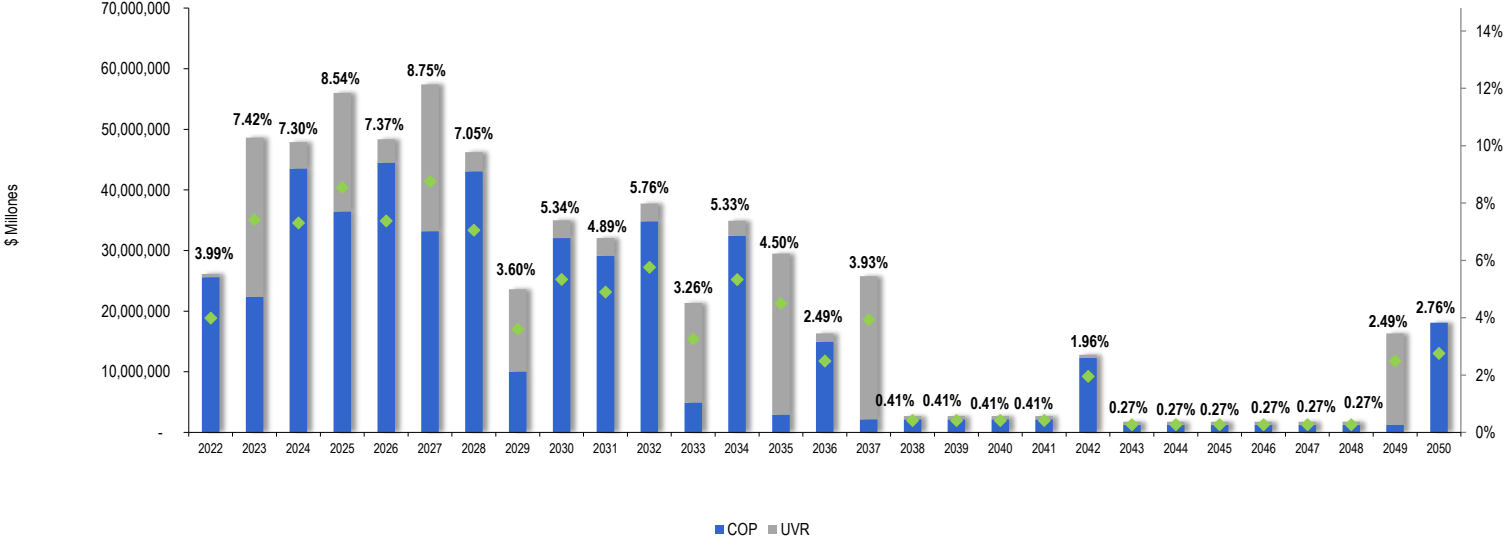
Perfil de Servicio de la Deuda

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	14,689,948	25,607,707	545,922	26,153,629	3.99%
2023	3,391,070	18,954,296	22,345,366	26,289,985	48,635,351	7.42%
2024	-	43,517,850	43,517,850	4,366,495	47,884,345	7.30%
2025	-	36,450,772	36,450,772	19,566,714	56,017,486	8.54%
2026	-	44,510,382	44,510,382	3,834,488	48,344,870	7.37%
2027	-	33,186,631	33,186,631	24,203,340	57,389,971	8.75%
2028	-	43,079,914	43,079,914	3,162,316	46,242,230	7.05%
2029	-	10,028,081	10,028,081	13,570,179	23,598,260	3.60%
2030	-	32,065,209	32,065,209	2,928,139	34,993,347	5.34%
2031	-	29,145,485	29,145,485	2,928,139	32,073,624	4.89%
2032	-	34,815,932	34,815,932	2,928,139	37,744,070	5.76%
2033	-	4,905,689	4,905,689	16,454,213	21,359,902	3.26%
2034	-	32,410,965	32,410,965	2,522,357	34,933,321	5.33%
2035	-	2,911,557	2,911,557	26,571,535	29,483,092	4.50%
2036	-	14,962,574	14,962,574	1,380,021	16,342,595	2.49%
2037	-	2,158,368	2,158,368	23,622,652	25,781,021	3.93%
2038	-	2,158,368	2,158,368	545,922	2,704,290	0.41%
2039	-	2,158,368	2,158,368	545,922	2,704,290	0.41%
2040	-	2,158,368	2,158,368	545,922	2,704,290	0.41%
2041	-	2,158,368	2,158,368	545,922	2,704,290	0.41%
2042	-	12,274,257	12,274,257	545,922	12,820,179	1.96%
2043	-	1,222,649	1,222,649	545,922	1,768,571	0.27%
2044	-	1,222,649	1,222,649	545,922	1,768,571	0.27%
2045	-	1,222,649	1,222,649	545,922	1,768,571	0.27%
2046	-	1,222,649	1,222,649	545,922	1,768,571	0.27%
2047	-	1,222,649	1,222,649	545,922	1,768,571	0.27%
2048	-	1,222,649	1,222,649	545,922	1,768,571	0.27%
2049	-	1,222,649	1,222,649	15,103,840	16,326,489	2.49%
2050	-	18,086,767	18,086,767	-	18,086,767	2.76%
TOTAL	14,308,829	445,346,690	459,655,519	195,983,613	655,639,133	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	49,784,766	67,478,168	117,262,934	28.05%
Fondos de Capital Extranjero ¹	99,980,406	7,314,495	107,294,901	25.67%
Bancos Comerciales	41,045,362	16,609,235	57,654,597	13.79%
Fiducia Publica	27,580,942	10,847,238	38,428,180	9.19%
Banco de la Republica	24,891,344	5,045,252	29,936,596	7.16%
Compañías de Seguros y Capitalizacion	6,818,758	20,936,037	27,754,794	6.64%
Instituciones Oficiales Especiales ²	13,588,478	4,636,498	18,224,976	4.36%
Carteras Colectivas y Fondos Administrados ³	3,429,220	1,545,187	4,974,407	1.19%
Ministerio de Hacienda y CP	1,630,141	3,290,247	4,920,388	1.18%
Corporaciones Financieras	2,229,358	1,134,151	3,363,509	0.80%
Fondos de Prima Media	1,571,282	1,389,709	2,960,991	0.71%
Personas Juridicas	1,298,218	366,182	1,664,400	0.40%
Entidades Publicas	1,014,698	58,586	1,073,283	0.26%
Comisionistas de Bolsa	511,063	262,961	774,024	0.19%
Proveedores de Infraestructura ⁴	379,833	187,180	567,013	0.14%
Entidades sin Animo de Lucro	396,536	37,098	433,634	0.10%
Administradoras de Carteras Colectivas y de Fdos Pensiones y Cesantías ⁵	268,038	113,866	381,904	0.09%
Personas Naturales	219,478	15,815	235,293	0.06%
Otros Fondos ⁶	70,169	8,999	79,168	0.02%
Compañías de Financiamiento Comercial	34,006	5,175	39,181	0.01%
Cooperativas Grado Super. Caracter Finan	6,000	-	6,000	0.00%
	276,748,094	141,282,081	418,030,175	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.