

Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B



El emprendimiento
es de todos

Minhacienda

Fecha de Corte : 31-oct-2021
TRM 3,784.44
UVR 287.3205

Indicadores y Composición General

Condiciones Financieras del Portafolio			
Concepto	(Millones de Pesos) Denominación		TOTAL
	TES PESOS	TES UVR	
Valor Nominal	270,692,691	127,728,664	398,421,356
Valor de Mercado	266,220,265	132,903,700	399,123,965
Cupón Promedio	6.803	8.555	7.365
Descuento Promedio	7.154	7.470	7.256
Vida Media	8.116	9.551	8.576
Duración	5.540	7.302	6.105
Duración Modificada	5.139	7.053	5.753
Participación	67.94%	32.06%	100.00%

Analisis Comparativo

Títulos de Tesorería TES Evolución del Perfil de Deuda (Millones de Pesos) Comportamiento Anual y Acumulado						
TOTAL GENERAL	oct-20	oct-21	Variación Anual	dic-20	Var. Acum	Var. Acum %
Valor Nominal	343,789,523	398,421,356	15.89%	347,949,545	50,471,811	14.51%
Valor de Mercado	383,605,490	399,123,965	4.05%	397,464,879	1,659,086	0.42%
Cupón Promedio	6.575	7.365	12.01%	6.458	91 pb	14.04%
Descuento Promedio	4.413	7.256	64.41%	3.964	329 pb	83.02%
Vida Media	7.766	8.576	10.43%	7.805	0.771	9.88%
Duración	5.868	6.105	4.04%	5.892	0.213	3.62%
Duración Modificada	5.624	5.753	2.30%	5.665	0.087	1.54%

Variación Anual				Variación Anual			
TES PESOS	oct-20	oct-21	Variación Anual	TES UVR	oct-20	oct-21	Variación Anual
Valor Nominal	233,215,110	270,692,691	16.07%	Valor Nominal	110,574,412	127,728,664	15.51%
Valor de Mercado	260,604,958	266,220,265	2.15%	Valor de Mercado	123,000,533	132,903,700	8.05%
Cupón Promedio	6.860	6.803	-0.83%	Cupón Promedio	5.974	8.555	43.18%
Descuento Promedio	4.707	7.154	51.98%	Descuento Promedio	3.792	7.470	96.98%
Vida Media	7.426	8.116	9.29%	Vida Media	8.483	9.551	12.59%
Duración	5.467	5.540	1.34%	Duración	6.714	7.302	8.76%
Duración Modificada	5.186	5.139	-0.91%	Duración Modificada	6.546	7.053	7.75%

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	13,136,998	257,555,693	270,692,691	127,728,664	398,421,356
Valor de Mercado	12,927,034	253,293,231	266,220,265	132,903,700	399,123,965
Cupón Promedio	-	7.150	6.803	8.555	7.365
Descuento Promedio	3.263	7.353	7.154	7.470	7.256
Vida Media	0.456	8.507	8.116	9.551	8.576
Duración	0.456	5.800	5.540	7.302	6.105
Duración Modificada	0.440	5.379	5.139	7.053	5.753

Portafolio por Tipo de Tasa y Denominación en Moneda Original

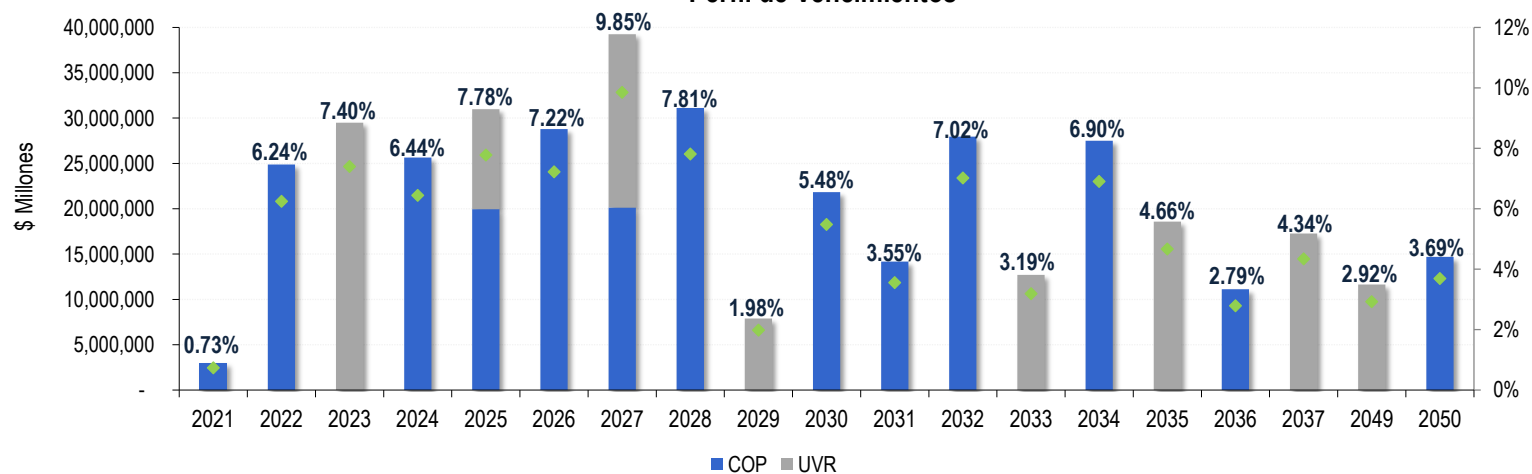
Concepto	Portafolio de TES por Tipo de Tasa			
	TES PESOS			TES UVR
	Descuento	Fija	Total COP	
Valor Nominal	13,136,998	257,555,693	270,692,691	444,551
Valor de Mercado	12,927,034	253,293,231	266,220,265	462,563
Cupón Promedio	-	7.150	6.803	3.870
Descuento Promedio	3.263	7.353	7.154	2.832
Vida Media	0.456	8.507	8.116	9.551
Duración	0.456	5.800	5.540	7.302
Duración Modificada	0.440	5.379	5.139	7.053

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			
2021	2,925,399	-	2,925,399	-	2,925,399	0.73%
2022	10,211,599	14,659,109	24,870,708	-	24,870,708	6.24%
2023	-	-	-	29,478,699	29,478,699	7.40%
2024	-	25,657,561	25,657,561	-	25,657,561	6.44%
2025	-	19,952,832	19,952,832	11,027,415	30,980,247	7.78%
2026	-	28,778,994	28,778,994	-	28,778,994	7.22%
2027	-	20,130,204	20,130,204	19,119,667	39,249,872	9.85%
2028	-	31,116,142	31,116,142	-	31,116,142	7.81%
2029	-	-	-	7,898,756	7,898,756	1.98%
2030	-	21,836,760	21,836,760	-	21,836,760	5.48%
2031	-	14,161,980	14,161,980	-	14,161,980	3.55%
2032	-	27,953,498	27,953,498	-	27,953,498	7.02%
2033	-	-	-	12,696,545	12,696,545	3.19%
2034	-	27,505,275	27,505,275	-	27,505,275	6.90%
2035	-	-	-	18,580,562	18,580,562	4.66%
2036	-	11,114,260	11,114,260	-	11,114,260	2.79%
2037	-	-	-	17,277,596	17,277,596	4.34%
2049	-	-	-	11,649,424	11,649,424	2.92%
2050	-	14,689,078	14,689,078	-	14,689,078	3.69%
TOTAL	13,136,998	257,555,693	270,692,691	127,728,664	398,421,356	100%

Perfil de Vencimientos



Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B



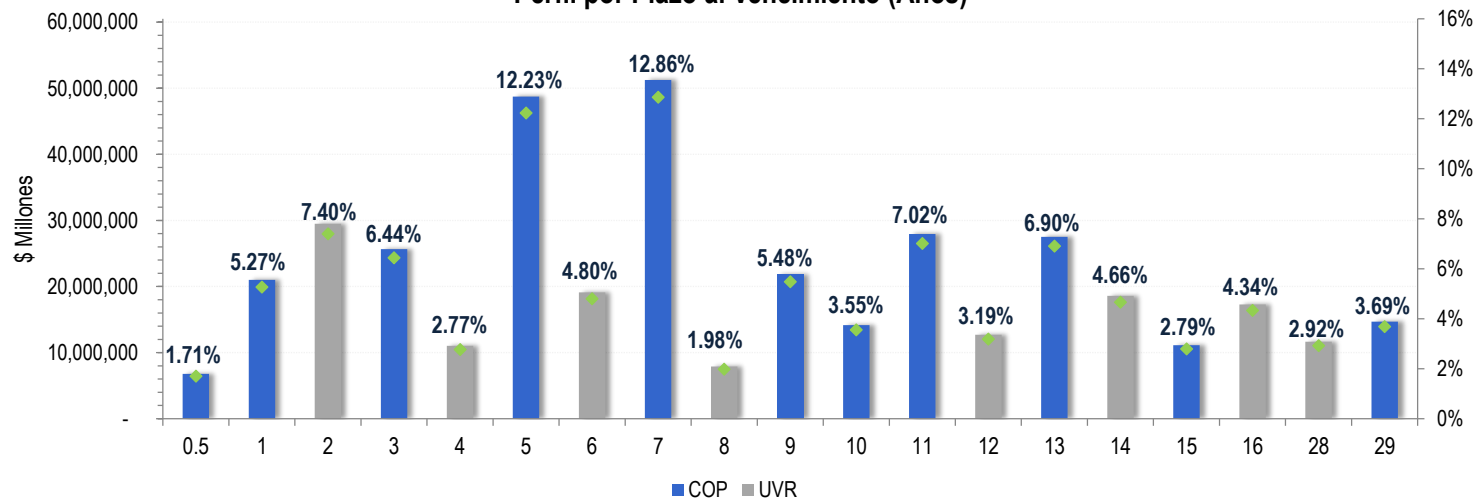
El emprendimiento
es de todos

Minhacienda

Portafolio por Plazo al Vencimiento

Plazo al Vencimiento (Años)	TES PESOS			TES UVR	TOTAL	Participacion
	Descuento	Fija	Total COP			
0.5	6,798,739	-	6,798,739	-	6,798,739	1.71%
1	6,338,259	14,659,109	20,997,368	-	20,997,368	5.27%
2	-	-	-	29,478,699	29,478,699	7.40%
3	-	25,657,561	25,657,561	-	25,657,561	6.44%
4	-	-	-	11,027,415	11,027,415	2.77%
5	-	48,731,826	48,731,826	-	48,731,826	12.23%
6	-	-	-	19,119,667	19,119,667	4.80%
7	-	51,246,347	51,246,347	-	51,246,347	12.86%
8	-	-	-	7,898,756	7,898,756	1.98%
9	-	21,836,760	21,836,760	-	21,836,760	5.48%
10	-	14,161,980	14,161,980	-	14,161,980	3.55%
11	-	27,953,498	27,953,498	-	27,953,498	7.02%
12	-	-	-	12,696,545	12,696,545	3.19%
13	-	27,505,275	27,505,275	-	27,505,275	6.90%
14	-	-	-	18,580,562	18,580,562	4.66%
15	-	11,114,260	11,114,260	-	11,114,260	2.79%
16	-	-	-	17,277,596	17,277,596	4.34%
28	-	-	-	11,649,424	11,649,424	2.92%
29	-	14,689,078	14,689,078	-	14,689,078	3.69%
TOTAL	13,136,998	257,555,693	270,692,691	127,728,664	398,421,356	100%

Perfil por Plazo al Vencimiento (Años)

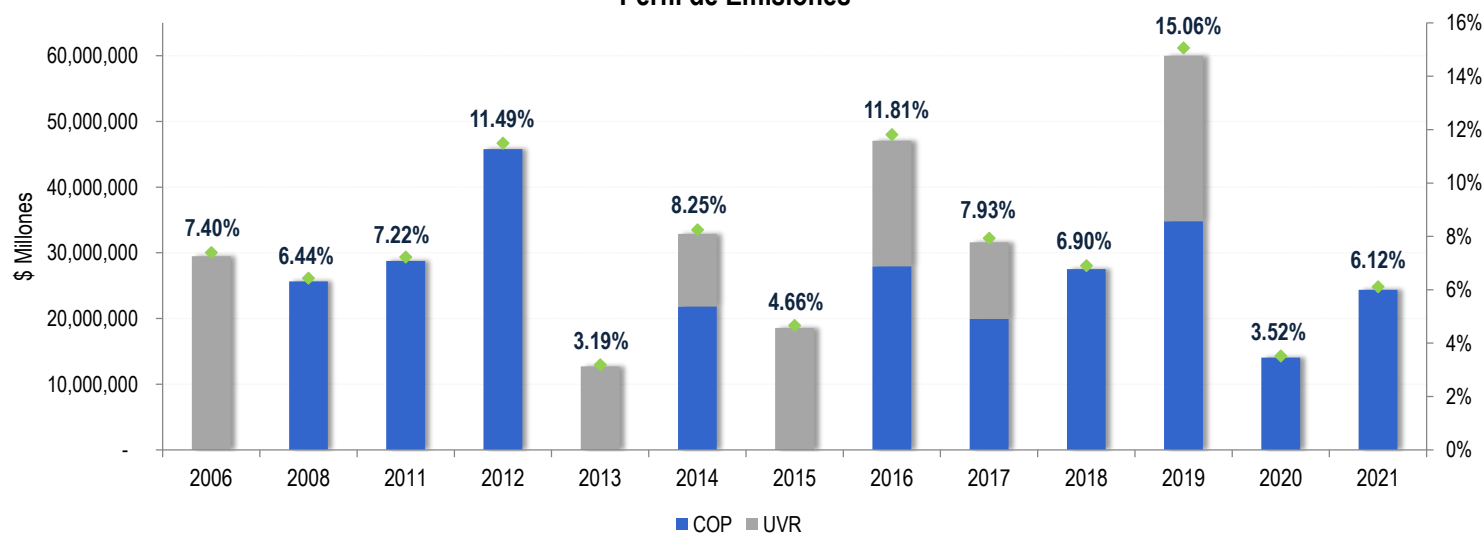


Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B

Portafolio por Año de Emisión

Año Emisión	Portafolio por Año de Emisión (Millones de Pesos)					
	TES PESOS			TES UVR	TOTAL	Participación
	Descuento	Fija	Total COP			
2006	-	-	-	29,478,699	29,478,699	7.40%
2008	-	25,657,561	25,657,561	-	25,657,561	6.44%
2011	-	28,778,994	28,778,994	-	28,778,994	7.22%
2012	-	45,775,251	45,775,251	-	45,775,251	11.49%
2013	-	-	-	12,696,545	12,696,545	3.19%
2014	-	21,836,760	21,836,760	11,027,415	32,864,175	8.25%
2015	-	-	-	18,580,562	18,580,562	4.66%
2016	-	27,953,498	27,953,498	19,119,667	47,073,165	11.81%
2017	-	19,952,832	19,952,832	11,649,424	31,602,256	7.93%
2018	-	27,505,275	27,505,275	-	27,505,275	6.90%
2019	-	34,819,282	34,819,282	25,176,353	59,995,635	15.06%
2020	2,925,399	11,114,260	14,039,659	-	14,039,659	3.52%
2021	10,211,599	14,161,980	24,373,579	-	24,373,579	6.12%
TOTAL	13,136,998	257,555,693	270,692,691	127,728,664	398,421,356	100%

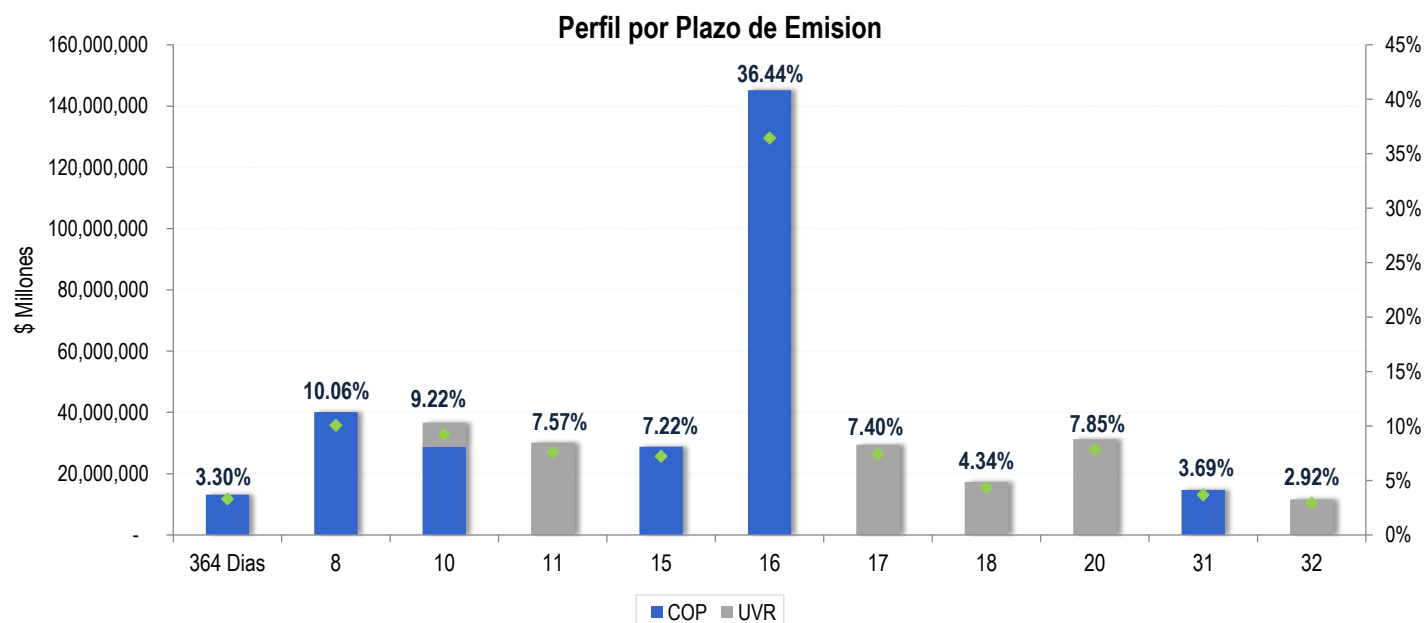
Perfil de Emisiones



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	13,136,998	-	13,136,998	-	13,136,998	3.30%
8	-	40,083,036	40,083,036	-	40,083,036	10.06%
10	-	28,821,089	28,821,089	7,898,756	36,719,845	9.22%
11	-	-	-	30,147,082	30,147,082	7.57%
15	-	28,778,994	28,778,994	-	28,778,994	7.22%
16	-	145,183,496	145,183,496	-	145,183,496	36.44%
17	-	-	-	29,478,699	29,478,699	7.40%
18	-	-	-	17,277,596	17,277,596	4.34%
20	-	-	-	31,277,107	31,277,107	7.85%
31	-	14,689,078	14,689,078	-	14,689,078	3.69%
32	-	-	-	11,649,424	11,649,424	2.92%
TOTAL	13,136,998	257,555,693	270,692,691	127,728,664	398,421,356	100%



Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B



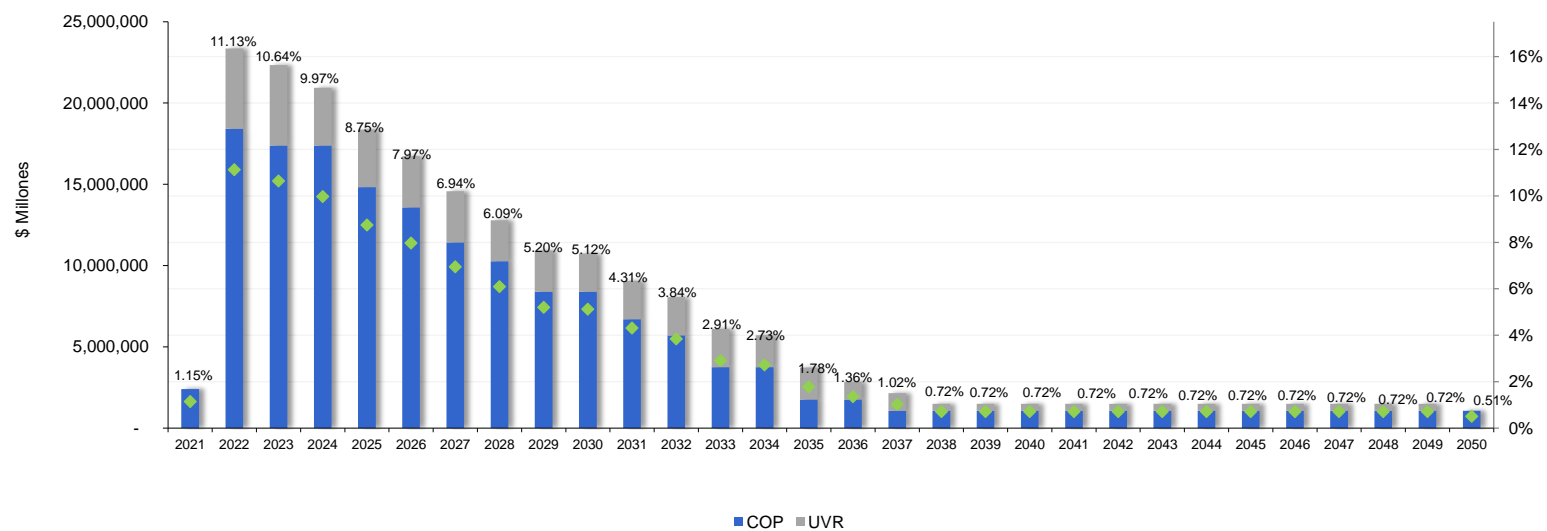
Perfil de Intereses

Año de Pago	Perfil de Intereses (Millones de Pesos)					
	TES PESOS			TES UVR	TOTAL	Participación
	Descuento	Fija	Total COP			
2021	-	2,404,539	2,404,539	-	2,404,539	1.15%
2022	-	18,415,990	18,415,990	4,943,105	23,359,095	11.13%
2023	-	17,389,852	17,389,852	4,943,105	22,332,957	10.64%
2024	-	17,389,852	17,389,852	3,542,867	20,932,719	9.97%
2025	-	14,824,096	14,824,096	3,542,867	18,366,963	8.75%
2026	-	13,577,044	13,577,044	3,156,907	16,733,951	7.97%
2027	-	11,418,619	11,418,619	3,156,907	14,575,527	6.94%
2028	-	10,261,133	10,261,133	2,525,958	12,787,091	6.09%
2029	-	8,394,164	8,394,164	2,525,958	10,920,122	5.20%
2030	-	8,394,164	8,394,164	2,348,236	10,742,400	5.12%
2031	-	6,701,815	6,701,815	2,348,236	9,050,052	4.31%
2032	-	5,710,477	5,710,477	2,348,236	8,058,713	3.84%
2033	-	3,753,732	3,753,732	2,348,236	6,101,968	2.91%
2034	-	3,753,732	3,753,732	1,967,340	5,721,072	2.73%
2035	-	1,759,599	1,759,599	1,967,340	3,726,939	1.78%
2036	-	1,759,599	1,759,599	1,084,763	2,844,363	1.36%
2037	-	1,064,958	1,064,958	1,084,763	2,149,721	1.02%
2038	-	1,064,958	1,064,958	436,853	1,501,812	0.72%
2039	-	1,064,958	1,064,958	436,853	1,501,812	0.72%
2040	-	1,064,958	1,064,958	436,853	1,501,812	0.72%
2041	-	1,064,958	1,064,958	436,853	1,501,812	0.72%
2042	-	1,064,958	1,064,958	436,853	1,501,812	0.72%
2043	-	1,064,958	1,064,958	436,853	1,501,812	0.72%
2044	-	1,064,958	1,064,958	436,853	1,501,812	0.72%
2045	-	1,064,958	1,064,958	436,853	1,501,812	0.72%
2046	-	1,064,958	1,064,958	436,853	1,501,812	0.72%
2047	-	1,064,958	1,064,958	436,853	1,501,812	0.72%
2048	-	1,064,958	1,064,958	436,853	1,501,812	0.72%
2049	-	1,064,958	1,064,958	436,853	1,501,812	0.72%
2050	-	1,064,958	1,064,958	-	1,064,958	0.51%
TOTAL	-	160,817,821	160,817,821	49,077,067	209,894,889	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**

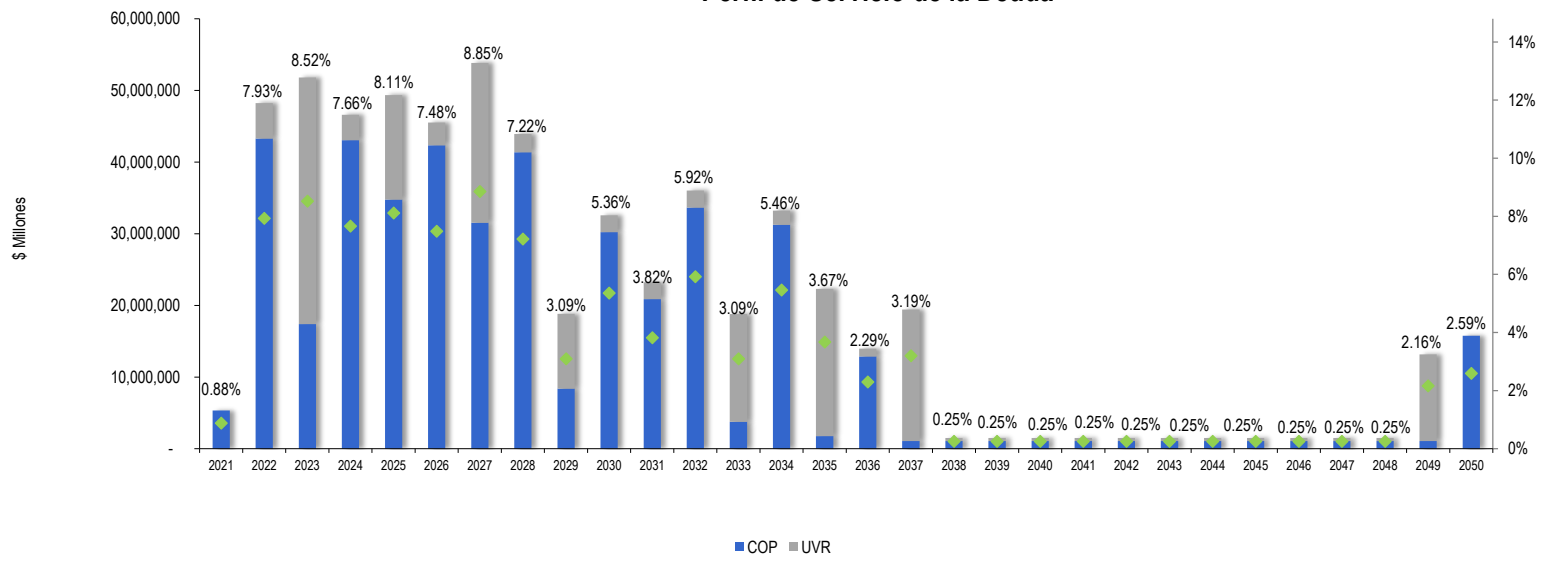
Minhacienda

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	2,925,399	2,404,539	5,329,938	-	5,329,938	0.88%
2022	10,211,599	33,075,099	43,286,698	4,943,105	48,229,803	7.93%
2023	-	17,389,852	17,389,852	34,421,804	51,811,656	8.52%
2024	-	43,047,413	43,047,413	3,542,867	46,590,280	7.66%
2025	-	34,776,928	34,776,928	14,570,282	49,347,210	8.11%
2026	-	42,356,038	42,356,038	3,156,907	45,512,945	7.48%
2027	-	31,548,824	31,548,824	22,276,575	53,825,399	8.85%
2028	-	41,377,275	41,377,275	2,525,958	43,903,233	7.22%
2029	-	8,394,164	8,394,164	10,424,715	18,818,879	3.09%
2030	-	30,230,924	30,230,924	2,348,236	32,579,161	5.36%
2031	-	20,863,795	20,863,795	2,348,236	23,212,031	3.82%
2032	-	33,663,974	33,663,974	2,348,236	36,012,210	5.92%
2033	-	3,753,732	3,753,732	15,044,781	18,798,513	3.09%
2034	-	31,259,007	31,259,007	1,967,340	33,226,347	5.46%
2035	-	1,759,599	1,759,599	20,547,902	22,307,502	3.67%
2036	-	12,873,859	12,873,859	1,084,763	13,958,622	2.29%
2037	-	1,064,958	1,064,958	18,362,359	19,427,318	3.19%
2038	-	1,064,958	1,064,958	436,853	1,501,812	0.25%
2039	-	1,064,958	1,064,958	436,853	1,501,812	0.25%
2040	-	1,064,958	1,064,958	436,853	1,501,812	0.25%
2041	-	1,064,958	1,064,958	436,853	1,501,812	0.25%
2042	-	1,064,958	1,064,958	436,853	1,501,812	0.25%
2043	-	1,064,958	1,064,958	436,853	1,501,812	0.25%
2044	-	1,064,958	1,064,958	436,853	1,501,812	0.25%
2045	-	1,064,958	1,064,958	436,853	1,501,812	0.25%
2046	-	1,064,958	1,064,958	436,853	1,501,812	0.25%
2047	-	1,064,958	1,064,958	436,853	1,501,812	0.25%
2048	-	1,064,958	1,064,958	436,853	1,501,812	0.25%
2049	-	1,064,958	1,064,958	12,086,277	13,151,235	2.16%
2050	-	15,754,036	15,754,036	-	15,754,036	2.59%
TOTAL	13,136,998	418,373,514	431,510,513	176,805,732	608,316,244	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



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	46,561,058	63,002,542	109,563,599	27.50%
Fondos de Capital Extranjero ¹	95,205,059	4,795,371	100,000,431	25.10%
Bancos Comerciales	41,628,884	16,641,491	58,270,376	14.63%
Fiducia Publica	26,612,516	9,878,873	36,491,388	9.16%
Banco de la Republica	24,774,281	4,541,276	29,315,557	7.36%
Compañías de Seguros y Capitalización	5,905,103	17,238,791	23,143,894	5.81%
Instituciones Oficiales Especiales ²	11,352,423	4,337,382	15,689,805	3.94%
Carteras Colectivas y Fondos Administrados ³	4,760,646	2,747,184	7,507,830	1.88%
Ministerio de Hacienda y CP	5,224,915	1,102,156	6,327,071	1.59%
Fondos de Prima Media ⁴	2,285,009	1,425,414	3,710,422	0.93%
Corporaciones Financieras	1,775,783	460,128	2,235,911	0.56%
Entidades Publicas	1,579,419	537,581	2,117,000	0.53%
Personas Juridicas	1,078,706	217,011	1,295,717	0.33%
Comisionistas de Bolsa	540,179	239,059	779,239	0.20%
Administradoras de Carteras Colectivas y de Fdos Pensiones y Cesantías ⁵	345,037	277,264	622,302	0.16%
Proveedores de Infraestructura	365,973	177,855	543,828	0.14%
Entidades sin Animo de Lucro	382,326	81,308	463,634	0.12%
Personas Naturales	177,951	12,893	190,843	0.05%
Otros Fondos ⁶	58,619	12,211	70,830	0.02%
Compañías de Financiamiento Comercial	59,306	2,873	62,179	0.02%
Cooperativas Grado Super. Caracter Finan	19,500	-	19,500	0.00%
	270,692,691	127,728,664	398,421,356	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.