

Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B



Fecha de Corte : 31-oct-2022
TRM 4,819.42
UVR 319.3680

Indicadores y Composición General

Condiciones Financieras del Portafolio			
Concepto	(Millones de Pesos)		TOTAL
	Denominación		
	TES PESOS	TES UVR	
Valor Nominal	297,028,147	153,768,715	450,796,862
Valor de Mercado	223,639,834	131,853,686	355,493,520
Cupón Promedio	6.970	15.619	9.920
Descuento Promedio	13.495	17.653	14.913
Vida Media	8.766	10.125	9.230
Duración	5.111	7.249	5.840
Duración Modificada	4.495	6.818	5.288
Participación	65.89%	34.11%	100.00%

Análisis Comparativo

Títulos de Tesorería TES						
Evolución del Perfil de Deuda						
(Millones de Pesos)						
Comportamiento Anual y Acumulado						
TOTAL GENERAL	oct-21	oct-22	Variación Anual	dic-21	Var. Acum	Var. Acum %
Valor Nominal	398,421,356	450,796,862	13.15%	397,878,200	52,918,662	13.30%
Valor de Mercado	399,123,965	355,493,520	-10.93%	396,934,555	(41,441,036)	-10.44%
Cupón Promedio	7.365	9.920	34.70%	7.644	228 pb	29.77%
Descuento Promedio	7.256	14.913	105.54%	7.771	714 pb	91.90%
Vida Media	8.576	9.230	7.62%	8.647	0.583	6.74%
Duración	6.105	5.840	-4.34%	6.119 -	0.280	-4.57%
Duración Modificada	5.753	5.288	-8.08%	5.761 -	0.473	-8.21%

Variación Anual				Variación Anual			
TES PESOS	oct-21	oct-22	Variación Anual	TES UVR	oct-21	oct-22	Variación Anual
Valor Nominal	270,692,691	297,028,147	9.73%	Valor Nominal	127,728,664	153,768,715	20.39%
Valor de Mercado	266,220,265	223,639,834	-15.99%	Valor de Mercado	132,903,700	131,853,686	-0.79%
Cupón Promedio	6.803	6.970	2.45%	Cupón Promedio	8.555	15.619	82.58%
Descuento Promedio	7.154	13.495	88.62%	Descuento Promedio	7.470	17.653	136.32%
Vida Media	8.116	8.766	8.01%	Vida Media	9.551	10.125	6.02%
Duración	5.540	5.111	-7.76%	Duración	7.302	7.249	-0.73%
Duración Modificada	5.139	4.495	-12.53%	Duración Modificada	7.053	6.818	-3.33%

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	12,355,069	284,673,078	297,028,147	153,768,715	450,796,862
Valor de Mercado	11,751,104	211,888,729	223,639,834	131,853,686	355,493,520
Cupón Promedio	-	7.272	6.970	15.619	9.920
Descuento Promedio	12.016	13.559	13.495	17.653	14.913
Vida Media	0.437	9.128	8.766	10.125	9.230
Duración	0.437	5.313	5.111	7.249	5.840
Duración Modificada	0.389	4.674	4.495	6.818	5.288

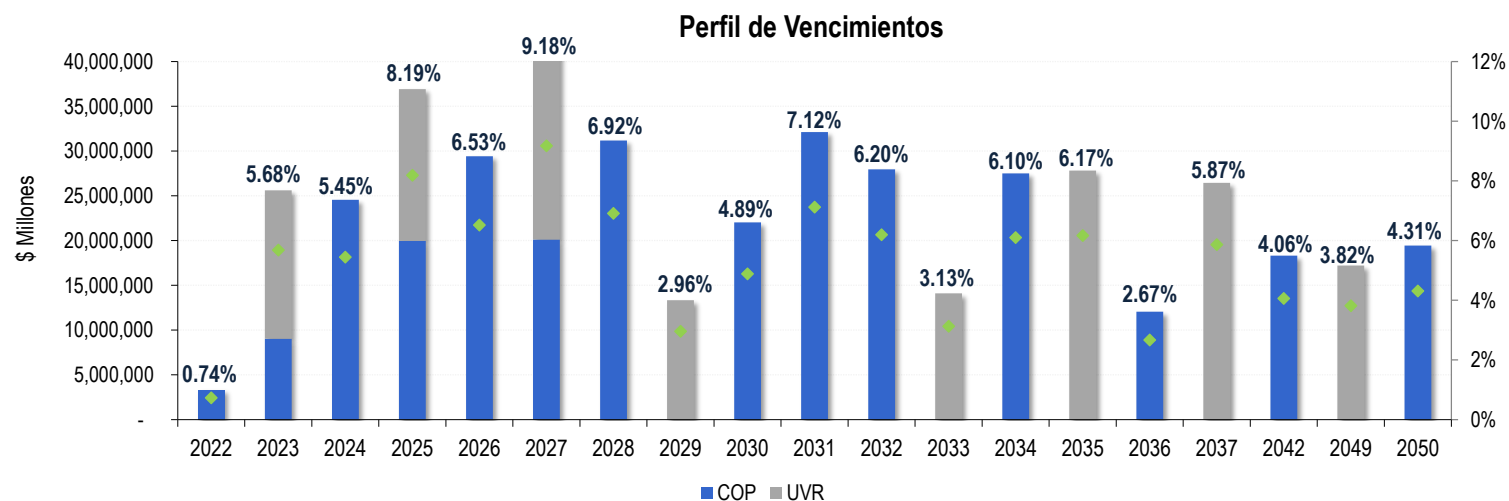
Portafolio por Tipo de Tasa y Denominación en Moneda Original

Concepto	Portafolio de TES por Tipo de Tasa			
	TES PESOS			TES UVR
	Descuento	Fija	Total COP	
Valor Nominal	12,355,069	284,673,078	297,028,147	481,478
Valor de Mercado	11,751,104	211,888,729	223,639,834	412,858
Cupón Promedio	-	7.272	6.970	3.750
Descuento Promedio	12.016	13.559	13.495	5.575
Vida Media	0.437	9.128	8.766	10.125
Duración	0.437	5.313	5.111	7.249
Duración Modificada	0.389	4.674	4.495	6.818

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
	Descuento	Fija	Total COP			
2022	3,314,000	-	3,314,000	-	3,314,000	0.74%
2023	9,041,069	-	9,041,069	16,583,685	25,624,754	5.68%
2024	-	24,563,554	24,563,554	-	24,563,554	5.45%
2025	-	19,952,832	19,952,832	16,964,473	36,917,305	8.19%
2026	-	29,419,494	29,419,494	-	29,419,494	6.53%
2027	-	20,130,204	20,130,204	21,252,260	41,382,464	9.18%
2028	-	31,180,975	31,180,975	-	31,180,975	6.92%
2029	-	-	-	13,350,478	13,350,478	2.96%
2030	-	22,037,127	22,037,127	-	22,037,127	4.89%
2031	-	32,118,687	32,118,687	-	32,118,687	7.12%
2032	-	27,953,498	27,953,498	-	27,953,498	6.20%
2033	-	-	-	14,112,707	14,112,707	3.13%
2034	-	27,505,275	27,505,275	-	27,505,275	6.10%
2035	-	-	-	27,832,381	27,832,381	6.17%
2036	-	12,051,017	12,051,017	-	12,051,017	2.67%
2037	-	-	-	26,456,534	26,456,534	5.87%
2042	-	18,321,222	18,321,222	-	18,321,222	4.06%
2049	-	-	-	17,216,197	17,216,197	3.82%
2050	-	19,439,192	19,439,192	-	19,439,192	4.31%
TOTAL	12,355,069	284,673,078	297,028,147	153,768,715	450,796,862	100%



Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B



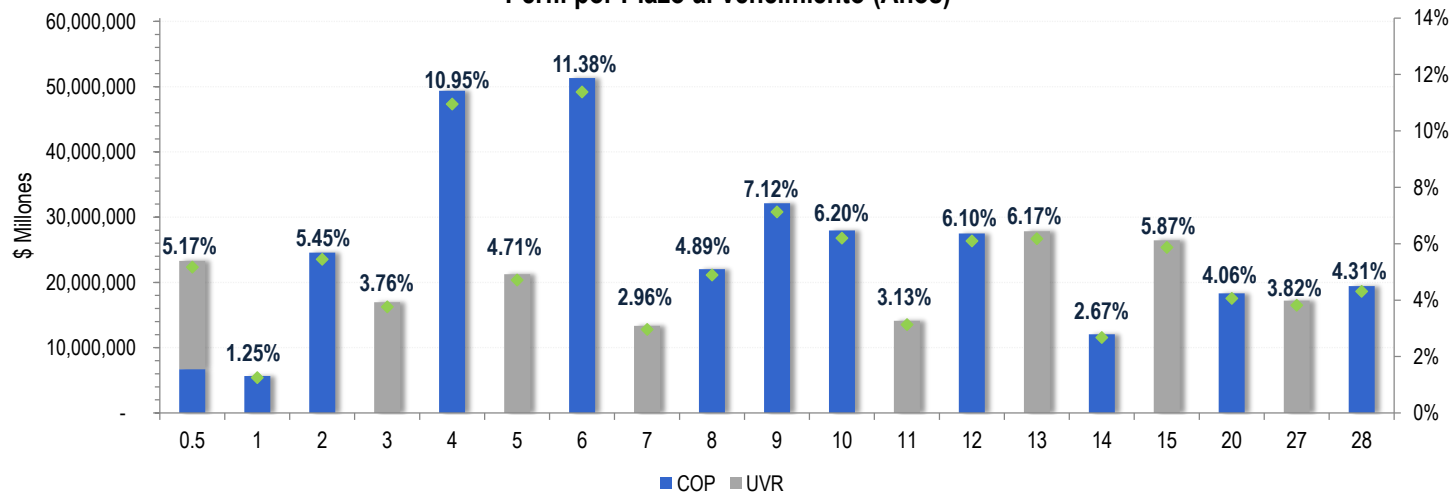
El emprendimiento
es de todos

Minhacienda

Portafolio por Plazo al Vencimiento

Plazo al Vencimiento (Años)	Portafolio por Plazo al Vencimiento (Millones de Pesos)			TES UVR	TOTAL	Participacion
	Descuento	TES PESOS Fija	Total COP			
0.5	6,705,070	-	6,705,070	16,583,685	23,288,755	5.17%
1	5,649,999	-	5,649,999	-	5,649,999	1.25%
2	-	24,563,554	24,563,554	-	24,563,554	5.45%
3	-	-	-	16,964,473	16,964,473	3.76%
4	-	49,372,326	49,372,326	-	49,372,326	10.95%
5	-	-	-	21,252,260	21,252,260	4.71%
6	-	51,311,179	51,311,179	-	51,311,179	11.38%
7	-	-	-	13,350,478	13,350,478	2.96%
8	-	22,037,127	22,037,127	-	22,037,127	4.89%
9	-	32,118,687	32,118,687	-	32,118,687	7.12%
10	-	27,953,498	27,953,498	-	27,953,498	6.20%
11	-	-	-	14,112,707	14,112,707	3.13%
12	-	27,505,275	27,505,275	-	27,505,275	6.10%
13	-	-	-	27,832,381	27,832,381	6.17%
14	-	12,051,017	12,051,017	-	12,051,017	2.67%
15	-	-	-	26,456,534	26,456,534	5.87%
20	-	18,321,222	18,321,222	-	18,321,222	4.06%
27	-	-	-	17,216,197	17,216,197	3.82%
28	-	19,439,192	19,439,192	-	19,439,192	4.31%
TOTAL	12,355,069	284,673,078	297,028,147	153,768,715	450,796,862	100%

Perfil por Plazo al Vencimiento (Años)



Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B



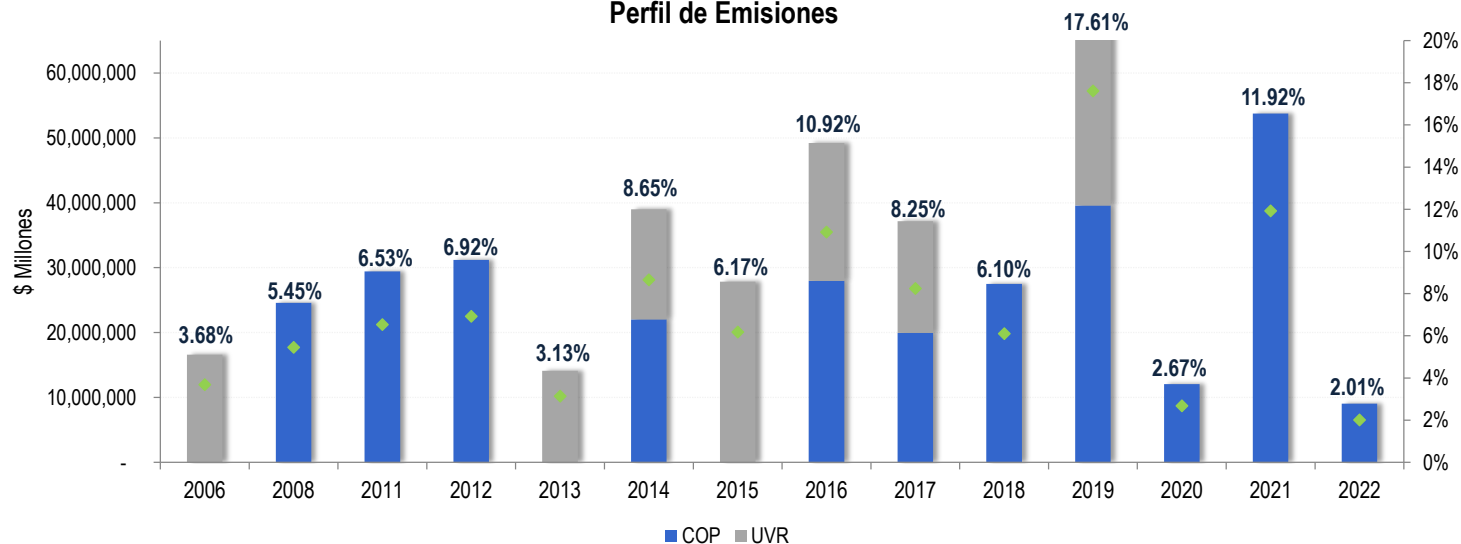
**El emprendimiento
es de todos**

Minhacienda

Portafolio por Año de Emisión

Año Emisión	TES PESOS (Millones de Pesos)			TES UVR	TOTAL	Participacion
	Descuento	Fija	Total COP			
2006	-	-	-	16,583,685	16,583,685	3.68%
2008	-	24,563,554	24,563,554	-	24,563,554	5.45%
2011	-	29,419,494	29,419,494	-	29,419,494	6.53%
2012	-	31,180,975	31,180,975	-	31,180,975	6.92%
2013	-	-	-	14,112,707	14,112,707	3.13%
2014	-	22,037,127	22,037,127	16,964,473	39,001,601	8.65%
2015	-	-	-	27,832,381	27,832,381	6.17%
2016	-	27,953,498	27,953,498	21,252,260	49,205,757	10.92%
2017	-	19,952,832	19,952,832	17,216,197	37,169,029	8.25%
2018	-	27,505,275	27,505,275	-	27,505,275	6.10%
2019	-	39,569,397	39,569,397	39,807,012	79,376,409	17.61%
2020	-	12,051,017	12,051,017	-	12,051,017	2.67%
2021	3,314,000	50,439,909	53,753,909	-	53,753,909	11.92%
2022	9,041,069	-	9,041,069	-	9,041,069	2.01%
TOTAL	12,355,069	284,673,078	297,028,147	153,768,715	450,796,862	100%

Perfil de Emisiones



Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B

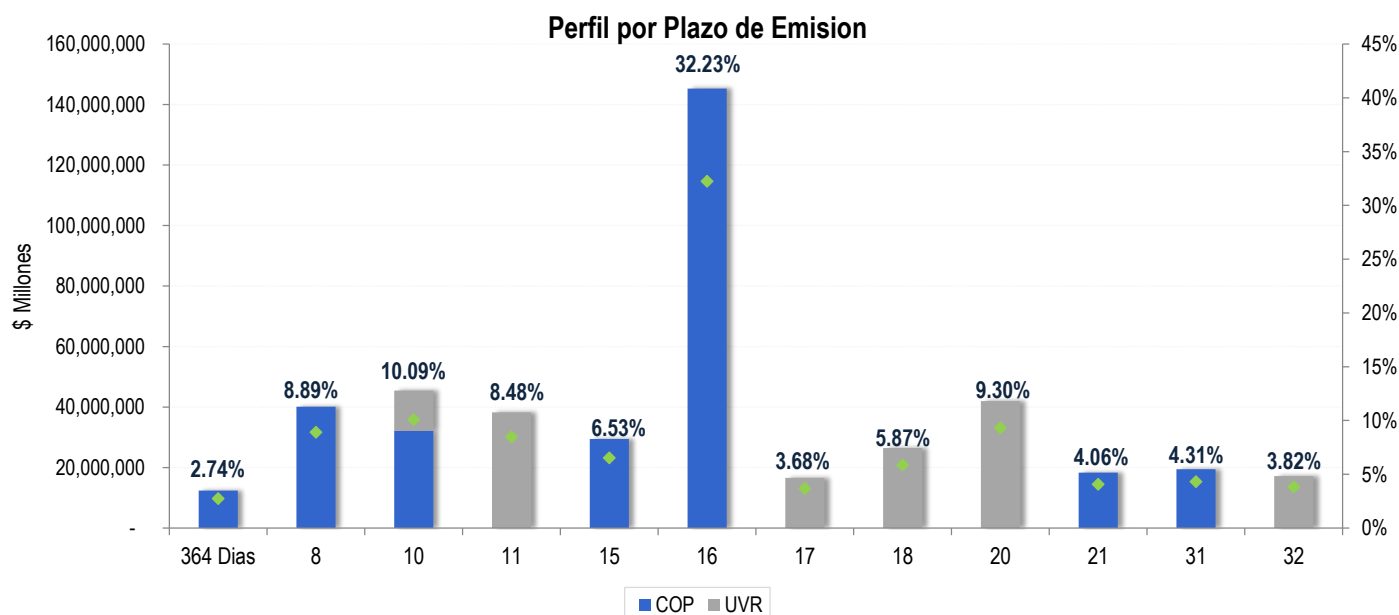


**El emprendimiento
es de todos**

Minhacienda

Portafolio por Plazo de Emisión

Portafolio por Plazo de Emision (Millones de Pesos)						
Plazo de Emisión (Años)	TES PESOS			TES UVR	TOTAL	Participación
	Descuento	Fija	Total COP			
364 Dias	12,355,069	-	12,355,069	-	12,355,069	2.74%
8	-	40,083,036	40,083,036	-	40,083,036	8.89%
10	-	32,118,687	32,118,687	13,350,478	45,469,165	10.09%
11	-	-	-	38,216,733	38,216,733	8.48%
15	-	29,419,494	29,419,494	-	29,419,494	6.53%
16	-	145,291,446	145,291,446	-	145,291,446	32.23%
17	-	-	-	16,583,685	16,583,685	3.68%
18	-	-	-	26,456,534	26,456,534	5.87%
20	-	-	-	41,945,089	41,945,089	9.30%
21	-	18,321,222	18,321,222	-	18,321,222	4.06%
31	-	19,439,192	19,439,192	-	19,439,192	4.31%
32	-	-	-	17,216,197	17,216,197	3.82%
TOTAL	12,355,069	284,673,078	297,028,147	153,768,715	450,796,862	100%



Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B

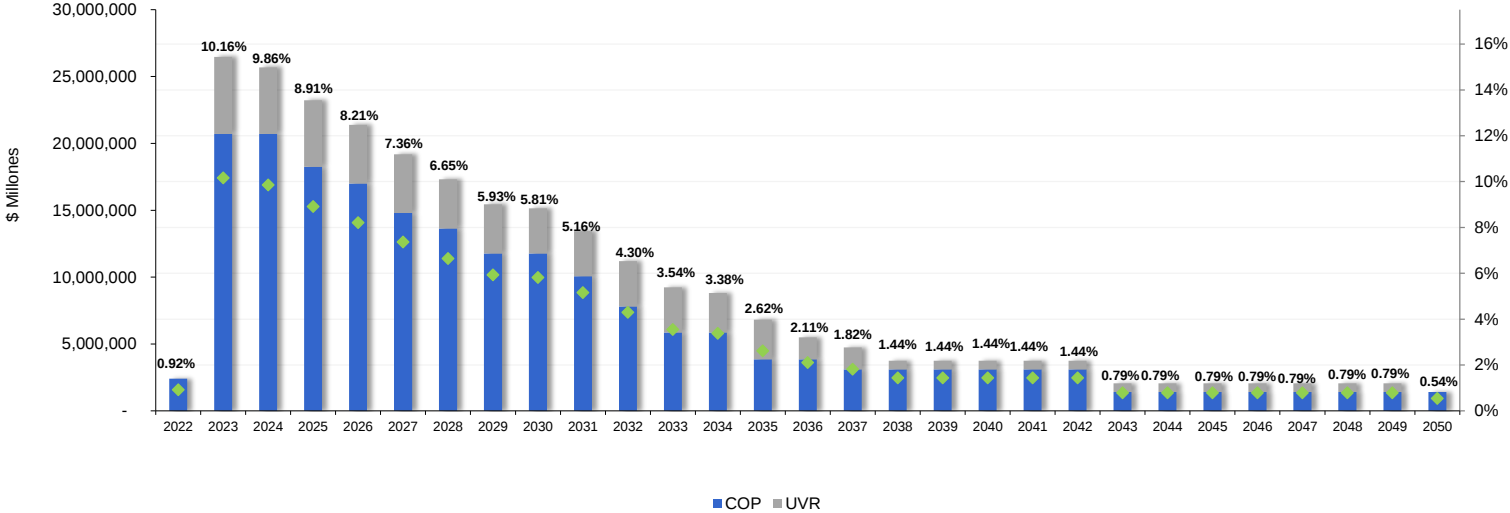


Perfil de Intereses

Año de Pago	Perfil de Intereses (Millones de Pesos)					
	TES PESOS			TES UVR	TOTAL	Participación
	Descuento	Fija	Total COP			
2022	-	2,404,539	2,404,539	-	2,404,539	0.92%
2023	-	20,702,520	20,702,520	5,766,339	26,468,859	10.16%
2024	-	20,702,520	20,702,520	4,978,614	25,681,134	9.86%
2025	-	18,246,165	18,246,165	4,978,614	23,224,779	8.91%
2026	-	16,999,113	16,999,113	4,384,857	21,383,970	8.21%
2027	-	14,792,651	14,792,651	4,384,857	19,177,508	7.36%
2028	-	13,635,164	13,635,164	3,683,532	17,318,697	6.65%
2029	-	11,764,306	11,764,306	3,683,532	15,447,838	5.93%
2030	-	11,764,306	11,764,306	3,383,147	15,147,453	5.81%
2031	-	10,056,428	10,056,428	3,383,147	13,439,575	5.16%
2032	-	7,808,120	7,808,120	3,383,147	11,191,267	4.30%
2033	-	5,851,376	5,851,376	3,383,147	9,234,522	3.54%
2034	-	5,851,376	5,851,376	2,959,766	8,811,141	3.38%
2035	-	3,857,243	3,857,243	2,959,766	6,817,009	2.62%
2036	-	3,857,243	3,857,243	1,637,727	5,494,970	2.11%
2037	-	3,104,055	3,104,055	1,637,727	4,741,782	1.82%
2038	-	3,104,055	3,104,055	645,607	3,749,662	1.44%
2039	-	3,104,055	3,104,055	645,607	3,749,662	1.44%
2040	-	3,104,055	3,104,055	645,607	3,749,662	1.44%
2041	-	3,104,055	3,104,055	645,607	3,749,662	1.44%
2042	-	3,104,055	3,104,055	645,607	3,749,662	1.44%
2043	-	1,409,341	1,409,341	645,607	2,054,949	0.79%
2044	-	1,409,341	1,409,341	645,607	2,054,949	0.79%
2045	-	1,409,341	1,409,341	645,607	2,054,949	0.79%
2046	-	1,409,341	1,409,341	645,607	2,054,949	0.79%
2047	-	1,409,341	1,409,341	645,607	2,054,949	0.79%
2048	-	1,409,341	1,409,341	645,607	2,054,949	0.79%
2049	-	1,409,341	1,409,341	645,607	2,054,949	0.79%
2050	-	1,409,341	1,409,341	-	1,409,341	0.54%
TOTAL	-	198,192,130	198,192,130	62,335,206	260,527,336	100%

Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B

Perfil de Intereses



Perfil de Deuda Interna
Títulos de Tesorería TES Clase B



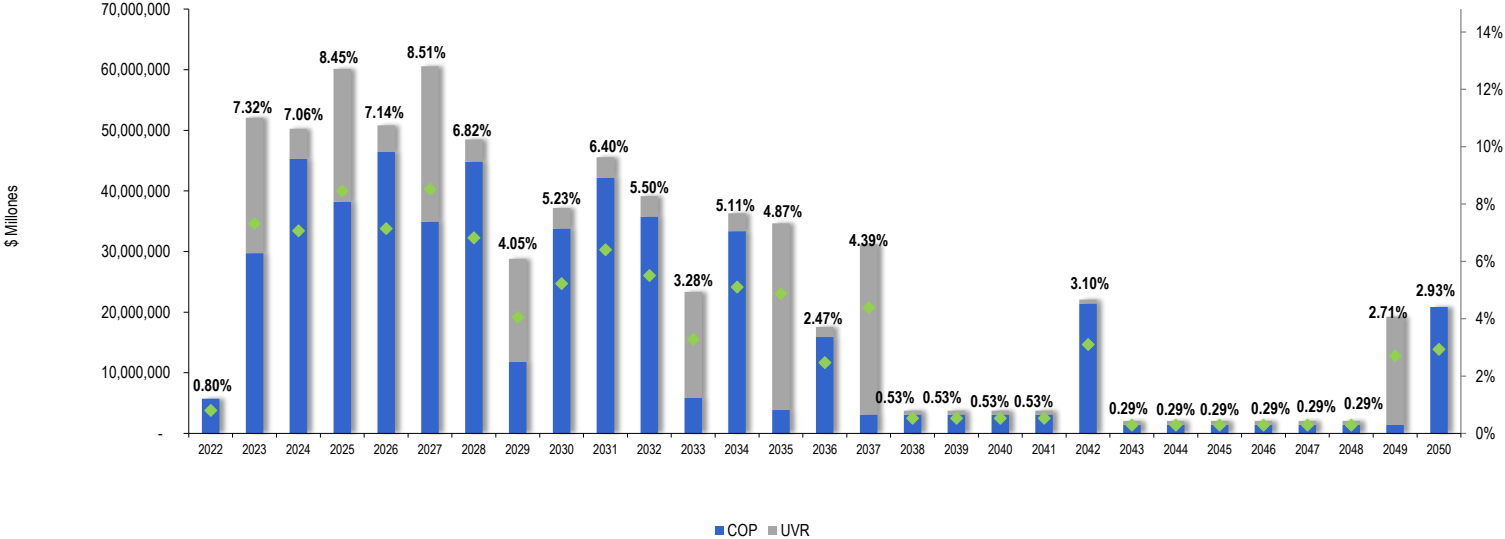
Perfil de Servicio de la Deuda

Año de Pago	Perfil de Servicio de Deuda (Millones de Pesos)					
	TES PESOS			TES UVR	TOTAL	Participación
	Descuento	Fija	Total COP			
2022	3,314,000	2,404,539	5,718,539	-	5,718,539	0.80%
2023	9,041,069	20,702,520	29,743,590	22,350,023	52,093,613	7.32%
2024	-	45,266,074	45,266,074	4,978,614	50,244,688	7.06%
2025	-	38,198,997	38,198,997	21,943,087	60,142,084	8.45%
2026	-	46,418,607	46,418,607	4,384,857	50,803,464	7.14%
2027	-	34,922,855	34,922,855	25,637,117	60,559,972	8.51%
2028	-	44,816,139	44,816,139	3,683,532	48,499,671	6.82%
2029	-	11,764,306	11,764,306	17,034,011	28,798,317	4.05%
2030	-	33,801,433	33,801,433	3,383,147	37,184,580	5.23%
2031	-	42,175,115	42,175,115	3,383,147	45,558,262	6.40%
2032	-	35,761,618	35,761,618	3,383,147	39,144,765	5.50%
2033	-	5,851,376	5,851,376	17,495,854	23,347,229	3.28%
2034	-	33,356,651	33,356,651	2,959,766	36,316,416	5.11%
2035	-	3,857,243	3,857,243	30,792,147	34,649,390	4.87%
2036	-	15,908,260	15,908,260	1,637,727	17,545,988	2.47%
2037	-	3,104,055	3,104,055	28,094,261	31,198,315	4.39%
2038	-	3,104,055	3,104,055	645,607	3,749,662	0.53%
2039	-	3,104,055	3,104,055	645,607	3,749,662	0.53%
2040	-	3,104,055	3,104,055	645,607	3,749,662	0.53%
2041	-	3,104,055	3,104,055	645,607	3,749,662	0.53%
2042	-	21,425,277	21,425,277	645,607	22,070,884	3.10%
2043	-	1,409,341	1,409,341	645,607	2,054,949	0.29%
2044	-	1,409,341	1,409,341	645,607	2,054,949	0.29%
2045	-	1,409,341	1,409,341	645,607	2,054,949	0.29%
2046	-	1,409,341	1,409,341	645,607	2,054,949	0.29%
2047	-	1,409,341	1,409,341	645,607	2,054,949	0.29%
2048	-	1,409,341	1,409,341	645,607	2,054,949	0.29%
2049	-	1,409,341	1,409,341	17,861,804	19,271,145	2.71%
2050	-	20,848,534	20,848,534	-	20,848,534	2.93%
TOTAL	12,355,069	482,865,207	495,220,276	216,103,921	711,324,197	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 Capital Extranjero ¹	110,915,899	9,105,425	120,021,324	26.62%
Fondos de Pensiones y Cesantías	45,865,386	70,444,265	116,309,651	25.80%
Bancos Comerciales	41,046,711	18,031,861	59,078,572	13.11%
Banco de la Republica	37,151,743	6,088,836	43,240,578	9.59%
Fiducia Publica	27,293,552	12,049,797	39,343,349	8.73%
Compañías de Seguros y Capitalizacion	7,618,358	24,595,240	32,213,597	7.15%
Instituciones Oficiales Especiales ²	13,904,378	5,102,321	19,006,698	4.22%
Carteras Colectivas y Fondos Administrados ³	3,070,322	1,993,306	5,063,627	1.12%
Ministerio de Hacienda y CP	1,722,947	2,949,230	4,672,177	1.04%
Corporaciones Financieras	2,899,340	1,215,322	4,114,662	0.91%
Fondos de Prima Media	1,597,782	1,306,266	2,904,048	0.64%
Personas Juridicas	1,084,471	226,823	1,311,294	0.29%
Entidades Publicas	1,171,760	95,685	1,267,446	0.28%
Proveedores de Infraestructura ⁴	442,433	284,402	726,835	0.16%
Comisionistas de Bolsa	367,198	105,151	472,349	0.10%
Entidades sin Animo de Lucro	328,986	47,298	376,284	0.08%
Administradoras de Carteras Colectivas y de Fdos Pensiones y Cesantías ⁵	233,538	109,543	343,081	0.08%
Personas Naturales	210,925	11,206	222,131	0.05%
Otros Fondos ⁶	66,419	3,545	69,964	0.02%
Compañías de Financiamiento Comercial	32,000	3,194	35,194	0.01%
Cooperativas Grado Super. Caracter Finan	4,000	-	4,000	0.00%
	297,028,147	153,768,715	450,796,862	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.