



Apo.414 Fr.002 Cumplido para Pago

PARA: SUBDIRECCION FINANCIERA Y GRUPO DE CONTRATOS

RADICADO No.: CP -

CONS 10

DATOS GENERALES DEL CONTRATO

CONTRATO, ORDEN O CONVENIO No. 3 - 019 - 2022



Radicado: 2-2022-050763

Bogotá D.C., 1 de noviembre de 2022 18:45

NIT O DOCUMENTO DE IDENTIFICACION DEL CONTRATISTA 1032505745

OBJETO DEL CONTRATO, ORDEN O CONVENIO PRESTAR SERVICIOS PROFESIONALES A LA SUBDIRECCIÓN DE RIESGO DE LA DIRECCIÓN GENERAL DE CRÉDITO PÚBLICO Y TESORO NACIONAL, EN ACTIVIDADES RELACIONADAS CON LA CONSTRUCCIÓN Y PROCESAMIENTO DE ESTADÍSTICAS PARA EL DESARROLLO DE MODELOS Y HERRAMIENTAS CUANTITATIVAS, ASÍ COMO EN LA ELABORACIÓN DE REPORTES Y ANÁLISIS DERIVADOS DE LA GESTIÓN DE LOS RIESGOS FISCALES TANTO DE LA DEUDA PÚBLICA COMO LA ESTRATEGIA DE COBERTURA DE LOS PRECIOS DEL PETRÓLEO

No.Compromiso 29722

FECHA DE SUSCRIPCION DEL CONTRATO, ORDEN O CONVENIO 18/01/2022

NOMBRE CONTRATISTA OSCAR DAVID BOTERO RAMIREZ VR DEL CONTRATO MAS ADICIONES 35,390,000.00

TOPE MÍNIMO DE SEGURIDAD SOCIAL

VALOR DEL CONTRATO 35,390,000.00
VALOR ADICIONES .00
FECHA DE INICIO: 21/01/2022
FECHA DE TERMINACION: 31/12/2022

Table with 4 columns: I.B.C., PENSION, SALUD, A.R.L. and values: 1,236,000, 197,800, 154,500, 6,500

VALOR PAGADO: 25,720,000.00 VALOR PENDIENTE POR EJECUTAR: 9,670,000.00 % EJECUCIÓN: 73

DATOS ESPECIFICOS DEL PAGO

Table with 9 columns: Tipo de Pago, No., Condicion de Pago, Aclaracion del, Valor.Pago, Iva Aplicado, Valor Iva, Amor Anticipada, Total a Pagar

TOTAL A PAGAR 3,090,000.00

PERIODO PAGADO - APORTES SEGURIDAD SOCIAL OCTUBRE DEL AÑO 2022

PLANILLA No. 1049253281

Anexos y No. de Folios

Table with 4 columns: Anexo, No. de Folios, Descripción, Cantidad

En calidad de Supervisor/Interventor del contrato enunciado, certifico que he verificado el cumplimiento a satisfaccion de las obligaciones que emanan del contrato, la acreditacion del pago de obligaciones con el sistema de seguridad social integral y las cifras y valores correspondientes al periodo certificado para el reconocimiento del pago que por este instrumento se acredita

Se firma a los 1 dias del mes de Noviembre del año 2022

SUPERVISORES Y/O INTERVENTORES

FIRMA: NOMBRE: SANTIAGO RODRIGUEZ MENDEZ CARGO: ASESOR CEDULA: 1032410363

Firmado digitalmente por:SANTIAGO RODRIGUEZ MENDEZ PROFESIONAL UNIVERSITARIO 2028-19

 El emprendimiento es de todos Minhacienda	Informe de Ejecución y Supervisión de Contrato	Código:	Apo.4.1.Fr.16
		Fecha:	22-03-2019
		Versión:	3
		Página:	1 de 3

CONTENIDO DEL INFORME

1.	Condiciones del Contrato	1
2.	Objeto del Contrato	1
3.	Obligaciones del Contrato, Actividades Ejecutadas y Productos Entregados.....	1

1. CONDICIONES DEL CONTRATO

Número de Contrato: 3.019-2022
 Nombre del Contratista: **OSCAR DAVID BOTERO RAMÍREZ**
 Periodo informe: del 1 de octubre al 31 de octubre de 2022
 Supervisor: Santiago Rodríguez Méndez
 Área perteneciente: Dirección de Crédito Público y Tesoro Nacional- Subdirección de Riesgo

2. OBJETO DEL CONTRATO

Prestar servicios profesionales a la Subdirección de Riesgo de la Dirección General de Crédito Público y Tesoro Nacional, en actividades relacionadas con la construcción y procesamiento de estadísticas para el desarrollo de modelos y herramientas cuantitativas, así como en la elaboración de reportes y análisis derivados de la gestión de los riesgos fiscales tanto de la deuda pública como la estrategia de cobertura de los precios de petróleo.

3. OBLIGACIONES DEL CONTRATO, ACTIVIDADES EJECUTADAS Y PRODUCTOS ENTREGADOS

Las obligaciones adquiridas son las siguientes:

<p>1. Proponer herramientas cuantitativas que permitan producir información significativa para la automatización de procesos de cálculo, generación de reportes y actualización de bases de datos, a partir de hojas de cálculo y paquetes informáticos como “R Studio” y “Stata”. Entre otros, en el marco de la gestión de riesgos, tanto de la deuda pública como de la estrategia de cobertura de los precios del petróleo.</p> <p>No se requiere a la fecha</p>
<p>2. Apoyar la elaboración de informes de evaluación sobre derivados financieros existentes en el mercado, susceptibles de implementarse en operaciones de deuda o cobertura de los precios del petróleo.</p> <p>Se apoyó en la elaboración del informe Cross Currency Swap, este informe se realiza con frecuencia diaria y semanal evaluando una ventana de oportunidad para convertir los créditos tasa fija en dólares a moneda local. Se descarga y calcula en Bloomberg de la curva swap para créditos bullet y amortizables según los nodos. Se hace la interpolación de las curvas de rendimientos y se evalúa cuales créditos pueden ser susceptibles de conversión a moneda local según su margen. Se calculan los swaps tasa fija de cada uno de los créditos y se comparan con sus respectivos límites, evidenciando cuantos puntos básicos se encuentran por debajo o por encima de la curva. Se analiza indicadores como devaluaciones y volatilidad.</p>

 El emprendimiento es de todos Minhacienda	Informe de Ejecución y Supervisión de Contrato	Código:	Apo.4.1.Fr.16
		Fecha:	22-03-2019
		Versión:	3
		Página:	2 de 3

Ruta: Z:\Deuda\Informes\No Periódicos\Solicitud cesar\Break Even_TRM\CCS 2022\1) Nueva Metodología con automatización

3. Apoyar la realización de exámenes detallados sobre el impacto de variables macro y los precios del petróleo en las finanzas de la Nación y su relación con los riesgos fiscales.

No se requiere a la fecha.

4. Participar en la elaboración de informes de investigación relacionados con el comportamiento de los diferentes indicadores que influyen en el mercado de la deuda y el petróleo.

No se requiere a la fecha.

5. Recopilar, construir, procesar y consolidar estadísticas, así como elaborar informes relacionados con el documento de política de deuda de la Nación y coberturas de los precios del petróleo.

- Apoyo en la actualización del concepto sobre un contrato de préstamo entre la Nación y el Banco Centroamericano de Integración Económica -BCIE, por un monto de US\$ 250 millones, debido a la transición de este a tasa SOFR-6M, evaluando tasas de interés, vida media, índice de concentración y valor presente de los intereses de las diferentes alternativas. Además, se incluyó un análisis sobre la posibilidad de fijar el margen variable y la tasa de interés del crédito, para obtener las mejores condiciones de financiamiento según los riesgos fiscales de la deuda pública.
Ruta: Z:\Deuda\Conceptos\Multilaterales \2022\BCIE 250 millones\Alcance SOFR

- Apoyo en la elaboración y actualización del análisis sobre la capacidad de pago del INVIAS relativa al proceso de titularización que esta entidad planea adelantar. Mediante esta operación, la entidad pretende recaudar COP \$1,38 billones, a través de la emisión de títulos en UVR con vencimientos hasta en 15 años, comprometiendo el 44,5% del recaudo de 22 peajes.
Ruta: Z:\Deuda\Conceptos\Conceptos\Otras Entidades\INVIAS

- Apoyo en la realización de un análisis sobre la capacidad de pago de Transmilenio S.A. relativa al proceso de titularización que esta entidad planea adelantar. Mediante esta operación, la entidad pretende recaudar COP \$2,97 billones, a través de la emisión de títulos en UVR con vencimientos hasta en 18 años, comprometiendo vigencias futuras asignadas a la entidad para la construcción de las troncales alimentadoras de la Primera Línea del Metro.
Ruta: Z:\Deuda\Conceptos\Conceptos\Otras Entidades\Transmilenio

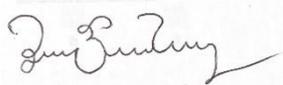
- Se apoyó en la realización de un ejercicio de cálculo de los factores que contribuyeron al cambio en el stock de deuda del GNC entre agosto y septiembre de 2022. Los factores analizados incluyeron la tasa de interés efectiva, tasa de cambio, inflación y nuevas emisiones para cubrir el déficit primario.
Ruta: Z:\Deuda\Informes\Perfiles\GNC\Perfil Total\Análisis sensibilidades y contribuciones\Inputs\Factores cambio deuda\2022\septiembre

- Brindar apoyo en la elaboración de documentos (presentaciones en PowerPoint, memorandos, oficios, etc.) e informes relacionados con endeudamiento público, riesgos fiscales y en general lo que requiera la Dirección General de Crédito Público y Tesoro Nacional.

- Apoyo en la elaboración del Informe Trimestral de Deuda con corte al 30 de septiembre de 2022. Este documento recopila los principales indicadores y características de la deuda, y sirve de herramienta práctica para la toma de decisiones sobre el perfil de la deuda. En concreto, incluye información sobre el perfil de vencimientos, índice de concentración, composición por moneda y

 El emprendimiento es de todos Minhacienda	Informe de Ejecución y Supervisión de Contrato	Código:	Apo.4.1.Fr.16
		Fecha:	22-03-2019
		Versión:	3
		Página:	3 de 3

<p>tasa, cupón promedio y vida media de la deuda. Además, incorpora estadísticas de valor en riesgo de la deuda frente a tasas de cambio e interés, y análisis de sensibilidad de la deuda frente a escenarios de estrés de estas mismas variables. Ruta: Z:\Deuda\Informes\Perfiles\GNC\Informe trimestral\2022\Septiembre</p> <ul style="list-style-type: none"> - Apoyo en la elaboración de una presentación sobre la operación de titularización de Transmilenio S.A. Este documento fue presentado al Director de Crédito Público para su aprobación. Ruta: Z:\Deuda\Conceptos\Conceptos\Otras Entidades\Transmilenio\Presentación Transmilenio.pptx - Apoyo en la elaboración de una presentación sobre la operación de titularización de INVIAS. Este documento fue presentado al Director de Crédito Público para su aprobación. Ruta: Z:\Deuda\Conceptos\Conceptos\Otras Entidades\INVIAS\Presentación INVIAS.pptx
<p>6. Asistir a las reuniones que el supervisor del contrato determine y que estén relacionados con el objeto del contrato.</p> <ul style="list-style-type: none"> - Se asistió a las reuniones de seguimiento semanal del Grupo de Pasivos.
<p>7. Mantener la confidencialidad o reserva necesaria en el desarrollo de sus labores.</p> <ul style="list-style-type: none"> • Cumplido
<p>8. Presentar los informes que se requiera a través de la supervisión del contrato, relacionados con el objeto contractual.</p> <ul style="list-style-type: none"> • Cumplido
<p>9. Cumplir con las demás actividades propias de la ejecución del objeto del contrato y que sean asignadas por el Supervisor del mismo.</p> <ul style="list-style-type: none"> • Cumplido



FIRMA CONTRATISTA

En mi calidad de supervisor del contrato me permito avalar el contenido del informe y el avance en la ejecución del mismo de acuerdo a lo descrito.

El contrato no presenta a la fecha dificultades en su ejecución, ni situaciones exógenas que afecten el normal desarrollo del mismo.



FIRMA SUPERVISOR