



El emprendimiento es de todos

Minhacienda

Código:

Apo.4.1.4Fr002

Fecha

19/11/2012

Versión

5

Apo.414 Fr.002 Cumplido para Pago

PARA: SUBDIRECCION FINANCIERA Y GRUPO DE CONTRATO RADICADO No.: CP -

CONS. 3

DATOS GENERALES DEL CONTRATO

CONTRATO, ORDEN O CONVENIO No.

3

108

2021

IDENTIFICACION CONTRATISTA

1070973827



Radicado: 2-2021-025662

Bogotá D.C., 18 de mayo de 2021 07:44

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. Compromisos

43921

FECHA DE SUSCRIPCION DEL CONTRATO, ORDEN O CONVENIO

29/01/2021

NOMBRE CONTRATISTA

HEIDY NATALI TRIVIÑO MORENO

VALOR DEL CONTRATO

33,600,000.00

VR DEL CONTRATO MAS ADICIONES

33,600,000.00

VALOR ADICIONES

.00

TOPE MINIMO DE SEGURIDAD SOCIAL

FECHA ACTA DE INICIO:

03/02/2021

I.B.C.

SALUD

150,000

FECHA DE FINAL

31/12/2021

PENSION

192,000

A.R.L.

6,300

DATOS ESPECIFICOS DEL PAGO

No.	Tipo de Pago	No.	Condicion del Pago	Aclaracion del Pago	Valor de Pago	Iva Aplicado	Valor IVA	Valor Amortizacion Anticipada	Total Pago
1	INFORME NO.	3	PERIODO	DEL 01 DE ABRIL A 31 DE ABRIL DE 2021	3,000,000.00	0 %	.00		3,000,000.00
TOTALES					3,000,000.00		.00		
TOTAL A PAGAR									3,000,000.00

PERIODO PAGADO - APORTES SEGURIDAD SOCIAL ABRIL DEL AÑO 2021

PLANILLA No. 50055795

Anexos y No. de Folios

Factura		Cuenta de Cobro		Declaracion juramentada Seguridad Social	1
Otros anexos o Folios	4	Entrada a Almacen		Constancias de pago de la seguridad social	2
				Total de Folios Anexos	7

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 12 dias del mes de Mayo del año 2021

SUPERVISORES Y/O INTERVENTORES


FIRMA:

NOMBRE: JAIME ORLANDO GAONA SANCHEZ

CARGO: COORDINADOR

CEDULA: 1020753484

Fecha creación Cumplido 12-05-2021

 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 4

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: 3108-2021
Nombre del Contratista: **HEIDY NATALI TRIVIÑO MORENO**
Periodo informe: del 01 de abril al 30 de abril de 2021

Supervisor: Jaime Orlando Gaona Sánchez
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:

1. Proponer herramientas 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.
 - Avance: Modelo Cross Currency Swap, se han identificado las variables explicativas a utilizar que son los parámetros como: curvas OIS42, curvas OISIBR y curvas COP basis, evaluando los diferentes nodos históricos y el spread entre la curva USD y la curva COP, otro parámetro es la tasa de cambio, y algunas variables como EMBI y VIX, que contribuyen a reflejar el comportamiento del mercado, los modelos analizados son: regresión lineal (MC0) y análisis de componentes principales (PCA), en el modelo de regresión lineal se analiza la contribución de las variables independientes y su nivel de significancia, así mismo se evalúa el RMSE y el MAE del Backtesting, con el modelo PCA se muestra la contribución de las variables y adicionalmente se elimina la multicolinealidad de las mismas, se reducen las variables a un componente o dos según su relación.
Ruta: Z:\Deuda\Modelos\Contribución Swap

 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 4

<p>2. Apoyar la elaboración de informes de evaluación sobre de derivados financieros existentes en el mercado, susceptibles de implementarse en operaciones de deuda o cobertura de los precios del petróleo.</p> <ul style="list-style-type: none"> - Avance: Apoyo al informe Cross Currency Swap, este informe se realiza con frecuencia semanal evaluando una ventana de oportunidad para convertir los créditos tasa fija en dólares a moneda local, se descarga y cálculo 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 limites, evidenciando cuantos puntos básicos se encuentran por debajo o por encima de la curva, se analiza indicadores como devaluaciones, volatilidad . Ruta: Z:\Deuda\Informes\No Periódicos\Solicitud cesar\Break Even_TRM\CCS 2021
<p>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.</p> <p>Avance: no se requiere aún.</p>
<p>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 de petróleo.</p> <ul style="list-style-type: none"> - Avance: MFMP. Apoyo en la elaboración de las secciones de riesgos financieros y gestión de riesgos de la deuda pública para el MFMP del 2021, análisis de datos de riesgos cambiarios y de inflación, de refinanciamiento y tasas de interés, con el fin de observar las exposiciones que tiene la nación en el corto plazo y el stock de la deuda. Se evalúan los ratios como TPR y vida media y cómo ha evolucionado en el tiempo. En la sección de gestión de riesgos se presentan las operaciones de manejo de deuda interna y externa, cómo los canjes y sustitución de deuda con el fin de mejorar el perfil, así como las operaciones que mitigan el riesgo de mercado como lo son las fijaciones de tasas de interés, se calculó el histórico de índice de concentración, con sus respectivos ajustes a los comentarios propuestos en las revisiones. Ruta: Z:\Deuda\MFMP\2021.
<p>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.</p> <ul style="list-style-type: none"> - Avance: Consolidar y enviar datos semanalmente de las disponibilidades de la Dirección del Tesoro Nacional – DTN en el Banco de la República de 2017 a 2021. - Informe OCDE: Elaboración del informe OCDE del IV trimestre de 2020, actualizando los datos de deuda del Gobierno Nacional Central, Sector Público No Financiero, Sector Público Financiero y la compilación en el Gobierno General, según el formato solicitado por la OCDE. Ruta: Z:\Deuda\Informes\Trimestral\OECD\2020\IV trim
<p>6. 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.</p> <ul style="list-style-type: none"> - Perfil de vencimientos: apoyo en la elaboración del perfil de vencimientos de marzo de 2021 y envío del mismo a la subdirección interna. Ruta: Z:\Deuda\Informes\Perfiles\GNC\Perfil de Vencimientos\2021

 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 4

	<ul style="list-style-type: none"> - Contribución Swap, actualizar base con variable dependiente swap (calculado en Bloomberg) e independientes como: tasas de cambio, inflación, tesoros entre otras, y descargar las curvas OIS42, USD192, OISIBR392, a diferentes plazos de corto y largo plazo, desde 1 día hasta 10 años. Ruta: Z:\Deuda\Modelos\Contribución Swap - BIRF 750M: Apoyo en la elaboración del concepto de BIRF por 750 millones, evaluando la curva de la all in cost vs las tasas fija en swap, el valor presente de los intereses, vida media e índice de concentración, eligiendo la alternativa que se ajuste a las necesidades de la nación y genere el mínimo costo. Z:\Deuda\Conceptos\Conceptos\Multilaterales\2021\BIRF 750 millones - BIRF 500M: Apoyo en la elaboración del concepto de BIRF por 500 millones, evaluando la curva de la all in cost vs las tasas fija en swap, el valor presente de los intereses, vida media e índice de concentración, eligiendo la alternativa que se ajuste a las necesidades de la nación según las opciones ofrecidas por el banco. Z:\Deuda\Conceptos\Conceptos\Multilaterales\2021\BIRF 500 millones - BID 100M: Apoyo en la elaboración del concepto de BID por 100 millones, evaluando la curva de la all in cost vs las tasas fija en swap, el valor presente de los intereses, vida media e índice de concentración, eligiendo la alternativa que se ajuste a las necesidades de la nación según las opciones ofrecidas por el banco. Z:\Deuda\Conceptos\Conceptos\Multilaterales\2021\BID 100 millones - CRA Survey Questions: Responder las preguntas de la encuesta CRA correspondientes al fondo de contingencia de la nación, cómo manejo del fondo, metodologías, composición y órganos de control de este. - Sensibilidad: Calculo de la sensibilidad de tasa variable libor, según la exposición de corto plazo para los meses con corte abril-19, jun-19, dic-19.
7.	<p>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"> - Reuniones de seguimientos MFMP - Capacitaciones en Bloomberg y Eikon.
8.	<p>Mantener la confidencialidad o reserva necesaria en el desarrollo de sus labores.</p> <ul style="list-style-type: none"> • Cumplido
9.	<p>Presentar los informes que se requieran a través de la supervisión del contrato, relacionados con el objeto contractual.</p> <ul style="list-style-type: none"> • Cumplido
10.	<p>Cumplir con las demás actividades propias de la ejecución del objeto del contrato y que sean asignadas por el supervisor del contrato.</p> <ul style="list-style-type: none"> • Cumplido

 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:	4 de 4


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