

 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: 3.108-2021
 Nombre del Contratista: **SAÚL EDUARDO BERRIS LAHPOUD**
 Periodo informe: del 1 de octubre al 31 de octubre
 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:

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. Se avanzó en la investigación para implementar el cálculo de ajuste de distribución disponible en el complemento de Excel "Risk Simulator" con el estadístico Kolmogorov-Smirnov en el lenguaje estadístico R y Python para tener a disposición más flexibilidad, mayor velocidad computacional y más opciones de distribuciones de probabilidad en los análisis estadísticos necesarios para la gestión de riesgos.
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. Se apoyó en la elaboración del 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 tasa fija en moneda local. Se descargó y calculó en Bloomberg la curva swap para créditos bullet y amortizables según los nodos, se realizó la interpolación de las curvas de rendimientos y se evaluó cuales créditos eran susceptibles de conversión a moneda local según su margen, también se

 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

calcularon los swaps a tasa fija de cada uno de los créditos y se compararon con sus respectivos límites, para conocer cuántos puntos básicos se encuentran por debajo o por encima de la curva.
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. - Se apoyó en la elaboración y publicación del perfil de Deuda del Gobierno Nacional Central-GNC del mes de septiembre, el cual se publica mensualmente en la página de IRC. Adicionalmente, se publicó el perfil Histórico de la Deuda en la página de IRC. Este documento contiene la evolución mensual de los indicadores más importantes de la deuda del GNC. - Se avanzó en la elaboración del Informe Trimestral de Deuda correspondiente a septiembre de 2021 con la metodología de VaR aplicada a todos los trimestres del año, para ver la evolución del indicador en tasa de interés y moneda. - Se elaboró y entregó el modelo de reemisión para hacer proyecciones de la deuda externa hasta 2030 que se le presenta al Banco de la República, teniendo en cuenta los créditos proyectados existentes, la Estrategia de Gestión de Deuda de Mediano Plazo y la composición de la deuda actual. - Se realizó la actualización del cupo de endeudamiento externo de la Nación con las amortizaciones, afectaciones, cancelaciones y contratación de créditos.
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. Se apoyó en la elaboración de conceptos solicitados a la subdirección de Riesgo sobre: i) Una operación de manejo de deuda pública de ICETEX, para realizar conversión de tasa de interés y moneda de un desembolso de un préstamo con el BIRF; ii) Actualización y alcance de operaciones de manejo de deuda para evaluar el cumplimiento de los criterios establecidos por el Comité de Tesorería para la conversión de moneda de dos créditos contratos por la Nación con el BID; iii) Actualización y alcance del tope de tasa fija máxima a la que la Nación contrataría un crédito con la CAF por US\$500 millones.
7. Asistir a las reuniones que el supervisor del contrato determine y que estén relacionados con el objeto del contrato. - Se asistió a las reuniones semanales que se llevan a cabo en el Grupo de Pasivos de la Nación para revisar las tareas y objetivos de la semana. - Se asistió a la reunión con el Banco de la República y la Dirección General de Política Macroeconómica para hacer extensión y compartir los avances en la elaboración del Perfil del Gobierno General. Se recomienda la próxima elaboración de un documento técnico que explique la metodología que se usa en la construcción del perfil.

 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

8. Mantener la confidencialidad o reserva necesaria en el desarrollo de sus labores. • Cumplido
9. Presentar los informes que se requiera a través de la supervisión del contrato, relacionados con el objeto contractual. • Cumplido
10. Cumplir con las demás actividades propias de la ejecución del objeto del contrato y que sean asignadas por el Supervisor del mismo. • 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