

 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: 3134-2021
Nombre del Contratista: **OSCAR DAVID BOTERO RAMIREZ**
Periodo informe: del 1 de septiembre al 30 de septiembre de 2021

Supervisor: Santiago Rodríguez Méndez
Área perteneciente: Dirección de Crédito Público y Tesoro Nacional- Subdirección de Riesgo

2. OBJETO DEL CONTRATO

Prestar los servicios de apoyo técnico a la Subdirección de Riesgo, en la elaboración de reportes de deuda y de documentos de gestión de riesgos fiscales de la Nación”.

3. OBLIGACIONES DEL CONTRATO, ACTIVIDADES EJECUTADAS Y PRODUCTOS ENTREGADOS

Las obligaciones adquiridas son las siguientes:

1. Apoyar en la elaboración y publicación del Perfil de Deuda del Gobierno Nacional Central - GNC Avance: no se requiere aún.
2. Apoyar en la elaboración de reportes de Deuda de la Nación donde se evalúen los riesgos de refinanciamiento y de mercado. Avance: 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 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 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. Ruta: Z:\Deuda\Informes\No Periódicos\Solicitud cesar\Break Even_TRM\CCS 2021
3. Apoyar en la elaboración, publicación y sistematización del Perfil de Deuda del Gobierno General. - Avance: Se apoyó en la elaboración de los perfiles territorial y del Gobierno General (Territorial + GNC) de diciembre de 2016 a junio de 2021. Se filtraron los inventarios de deuda para cada trimestre. Se eliminaron los registros que correspondan a deuda del GNC. A través de una macro en Excel, se depuró la base modificada para identificar y corregir cualquier error en las fechas de

 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

desembolso o vencimiento, o en los intereses. Se utilizaron 4 macros, una primera que identifica los créditos en los que se presentan inconsistencias, después se corrió una segunda en que se corrigieron los errores relacionados con fecha de vencimiento, fecha de primer pago y tipo de tasa de interés de los créditos. Esto se hizo comparando la información del inventario corregido del trimestre anterior con la del trimestre actual, para aprovechar las correcciones realizadas en ocasiones previas. Después de correr la segunda macro, se corrió de nuevo la primera con la base modificada, para identificar los errores restantes. Hecho esto, se corrió una tercera macro que verifica aquellos créditos con pagos de intereses y amortización permitiendo agregar o corregir las tablas guías según corresponda. Después del proceso de depuración, se procedió a corregir los errores remanentes (aproximadamente de 10 a 15) manualmente, extrayendo la información de las hojas de vida de los créditos respectivos.

Una vez se tuvo el inventario depurado sin errores, se procedió a generar los flujos de la base, información con la cual se construyen los indicadores de deuda territorial y el perfil de deuda territorial para el trimestre en cuestión. Este documento contiene la información sobre la composición por fuente, denominación y tasa, y el perfil de vencimientos de la deuda de entidades públicas descentralizadas (territoriales) y establecimientos públicos. El Perfil del Gobierno General resulta de la agregación del perfil del GNC y el perfil territorial.

Ruta: Z:\Deuda\Informes\Perfiles\GG\Perfil Deuda Territorial\PERFIL BASE\YYYY

4. Apoyar en la elaboración de reportes derivados de la Base de Deuda Pública para otras dependencias del Ministerio y entidades públicas.

- Resolución de pagos octubre 2021. Se contrastó la resolución emitida por el Grupo de servicio de la deuda con el pago de amortizaciones e interés del mes de septiembre obtenidos del sistema de deuda de la DGPTN. Se comparó el servicio de deuda de ambos (amortizaciones y comisiones más intereses) y en los casos de inconsistencia se informó a la persona encargada del grupo de servicio de la deuda.

Ruta: Z:\Deuda\Informes\Mensual\Resolución de Pagos\2021

5. Realizar la actualización y registro de las proyecciones de mercado de tasas de interés y monedas, así como inventarios de endeudamiento, en el aplicativo de deuda de la DGPTN.

Avance: no se requiere aún.

6. Apoyar en la elaboración y diseño de presentaciones relacionadas con temas coyunturales que realiza la Subdirección de Riesgo.

- OMDs Septiembre: Se apoyó en la elaboración de conceptos sobre Operaciones de Manejo de Deuda Interna con el portafolio de Títulos TES de la Dirección de Tesoro Nacional, evaluando el intercambio de TES de corto plazo por títulos de mediano y largo plazo. En el marco de lo dispuesto por el Decreto 1068 de 2015, se analizaron aspectos como el saldo nominal, la vida media, el cupón promedio y la concentración de amortizaciones de la deuda interna para determinar la conveniencia de la operación propuesta en términos de sus implicaciones sobre el perfil y el riesgo de refinanciamiento de la deuda.

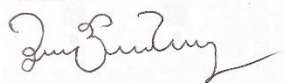
Ruta: Z:\Deuda\Conceptos\Conceptos\Financiamiento Interno\2021\OMD Septiembre

- Se apoyó en la elaboración de los conceptos sobre la emisión de títulos de tesorería TES para el pago a los departamentos de Caldas y Quindío por concepto de la cofinanciación de la Nación para el pago de las deudas por conceptos de servicios y tecnologías en salud no financiadas con cargo a la UPC del régimen subsidiado. Se analizaron la estructura de emisión de los TES en línea con lo dispuesto en la EGDMP, y el perfil de vencimientos de la deuda del GNC, seleccionando el

 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

año de vencimiento de los TES de forma que se extienda la vida media de la deuda y manteniendo una concentración que no exceda el 8% del total de la deuda para los vencimientos de cada año. Ruta: Z:\Deuda\Conceptos\Conceptos\Financiamiento Interno\2021\Salud Caldas - Se apoyó en la revisión de literatura sobre recompra de deuda en el mercado secundario, para definir un modelo que permita seleccionar el perfil de los títulos a intercambiar cuando se realizan operaciones de manejo de deuda interna con títulos de tesorería TES. Se ha revisado la metodología de los modelos empleados en el marco de los programas de recompra de deuda interna de países como Reino Unido. Ruta: Z:\Deuda\Papers\Modelo OMD - Se apoyó en la elaboración de la presentación del director general de crédito público para Asobancaria, en la sección “Gestión proactiva de riesgos”. En concreto, se trabajó en la sección de riesgo de liquidez, donde se graficó el saldo de las disponibilidades de la Dirección del Tesoro Nacional en el Banco de la República de 2017 a septiembre de 2021. Ruta: Z:\Deuda\Presentaciones\2021\Presentación Cesar Asobancaria - Se actualizó el gráfico de las disponibilidades de la Dirección del Tesoro Nacional – DTN en el Banco de la República de 2017 a 2021, que incluye depósitos no remunerados, depósitos remunerados e intereses de depósitos remunerados. Ruta: Z:\Deuda\Informes\Saldo depósitos GNC en BR	
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 capacitación brindada por Bloomberg sobre nuevas funcionalidades de la plataforma y las actualizaciones de mercado en favor de las tareas del grupo. - Se asistió a la reunión de seguimiento de los OMD de tesorería, en la que se habló de la agenda metodológica a seguir para la realización de Operaciones de Manejo de Deuda Pública con la Subdirección de Tesorería hasta por el monto del portafolio de la Subdirección de Tesorería, en concordancia con el decreto 1068 de 2015.
8. Mantener la confidencialidad o reserva necesaria en el desarrollo de sus labores.	• Cumplido
9. Entregar documentos generados por la prestación de servicios de apoyo técnico, los cuales pertenecerán a este Ministerio, tales como: Hojas de cálculo del perfil de la deuda mensual del Gobierno Nacional Central, Informe trimestral de deuda del Gobierno Nacional Central, Reporte trimestral del modelo de remisión de deuda de la Subdirección de Riesgo, Documento con los resultados de la medición de los riesgos fiscales de Empresas Comerciales Industriales del Estado.	• Cumplido
10. Cumplir con las demás actividades propias de la ejecución del objeto del contrato y que sean asignadas por el supervisor del contrato.	• Cumplido

	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