

Apo.4.1.Fr.002 Cumplido para Pago

Codigo:

Apo.4.1.Fr002

Fecha

31/01/2023

Versión

6

PARA: SUBDIRECCION FINANCIERA Y GRUPO DE CONTRATOS

RADICADO No.: CP -

CONS 3

DATOS GENERALES DEL CONTRATO

CONTRATO, ORDEN O CONVENIO No.

3

.

494

-

2023

NIT O DOCUMENTO DE IDENTIFICACION DEL CONTRATISTA

1004691135

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 EL DESARROLLO DE ACTIVIDADES DE SEGUIMIENTO, AJUSTE Y ACTUALIZACIÓN DE METODOLOGÍAS DE CUANTIFICACIÓN, GESTIÓN Y MITIGACIÓN DE RIESGOS, RELACIONADAS CON LA MEDICIÓN DEL IMPACTO FINANCIERO DE LA ESTRATEGIA DE COBERTURAS DE PETRÓLEO DE LA NACIÓN Y DE LA ESTRATEGIA DE GESTIÓN DE LA DEUDA DE MEDIANO PLAZO.

No.Compromiso

196423

FECHA DE SUSCRIPCION DEL CONTRATO, ORDEN O CONVENIO

26/12/2023

NOMBRE CONTRATISTA

ANDRES JAVIER ERAZO PAZOS

SALDO

65,147,500.00

VALOR DEL CONTRATO

65,147,500.00

VALOR ADICIONES

.00

FECHA DE INICIO:

28/12/2023

FECHA DE TERMINACION:

30/09/2024

VALOR PAGADO:

710,700.00

VALOR PENDIENTE POR EJECUTAR:

64,436,800.00

% EJECUCIÓN:

1

DATOS ESPECIFICOS DEL PAGO

Tipo de Pago	No.	Condicion de Pago	Aclaracion del	Valor.Pago	Iva Aplicado	Valor Iva	Amortizacion Anticipada	Total a Pagar
INFORME NO.	2	PERIODO	DEL 01 DE ENERO DE 2024 AL 31 DE ENERO DE 2024	7,107,000.00	%			7,107,000.00
		TOTALES		7,107,000.00				

TOTAL A PAGAR

7,107,000.00

Anexos y No. de Folios

Factura

Cuenta de Cobro

1

Declaracion juramentada Seguridad Social

1

Otros Anexos o Folios

1

Entrada a Almacen

Constancias de pago de la seguridad social

1

Total de Folios Anexos

4

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

SUPERVISORES Y/O INTERVENTORES

CRUZ JIMENEZ

Firmado digitalmente por CRUZ JIMENEZ JEFFREY STEBAN Fecha: 2024.02.05 15:21:22 -05'00'

JEFFREY STEBAN

FIRMA:

NOMBRE: JEFFREY ESTEBAN CRUZ JIMENEZ

CARGO: ASESOR

CEDULA: 1030645236

CON_R3041

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: 3.494-2023
 Nombre del Contratista: **Andrés Javier Erazo Pazos**
 Periodo informe: del 01 de enero de 2024 al 31 de enero de 2024
 Supervisor: Jeffrey Steban Cruz Jiménez
 Área perteneciente: 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 el desarrollo de actividades de seguimiento, ajuste y actualización de metodologías de cuantificación, gestión y mitigación de riesgos, relacionadas con la medición del impacto financiero de la estrategia de coberturas de petróleo de la nación y de la Estrategia de Gestión de la Deuda de Mediano Plazo.

3. OBLIGACIONES DEL CONTRATO, ACTIVIDADES EJECUTADAS Y PRODUCTOS ENTREGADOS

Las obligaciones adquiridas son las siguientes:

- | |
|--|
| <ol style="list-style-type: none"> 1. Participar en la consolidación de variables para los ajustes de modelos que permiten la cuantificación, gestión y mitigación de riesgos para las diferentes áreas de la Dirección General de Crédito Público y Tesoro Nacional, en los relacionado con la EGDMP. <p>Avance:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Se elaboró la consolidación de estadísticas relacionadas a insumos necesarios para la ejecución de la herramienta de petróleo con el objetivo de generar pronósticos útiles para la toma de decisiones. Los datos fueron consolidados desde Bloomberg, Banco de la República y desde las bases internas del Ministerio de Hacienda y Crédito Público; el pronóstico entregado corresponde a la Tasa Representativa del Mercado estresada con periodicidad mensual desde febrero de 2024 hasta diciembre de 2025 y la metodología de estimación se realiza mediante un modelo dinámico condicional de volatilidad. 2. Se realizó la consolidación del cierre estadístico de deuda correspondiente al mes de diciembre de 2023 mediante las herramientas suministradas por parte del Grupo de Pasivos de la Nación de la Subdirección de Riesgo. Los datos fueron |
|--|

obtenidos de áreas adscritas a la Dirección General de Crédito Público tales como: Subdirección de Financiamiento Interno y Externo, Subdirección de Tesorería, Subdirección de Operaciones, Banco de la República y Oficina de Bonos Pensionales. El producto final entregado corresponde al perfil de deuda interna, externa y total del Gobierno Nacional Central. - Se realizó la consolidación del perfil histórico y de vencimientos de cierre de vigencia del 2023; en ese orden de ideas, se consolidaron los insumos necesarios para la elaboración de las estadísticas para la toma de decisiones de la dirección. - Se elaboraron 3 conceptos relacionados a Garantías para contratación de créditos con BANCOLOMBIA, BBVA y BANCO DE BOGOTÁ por parte de Distrito Capital. En ese orden de ideas, se realizó la verificación de los informes económicos y financieros suministrados por la entidad con el objetivo de verificar las garantías otorgadas por parte de la nación y dar aprobación a Distrito Capital para la continuidad del proceso con los bancos en cuestión. - Se brindó apoyo en la valoración de bonos pertenecientes al portafolio de la nación (bonos Yankees) realizando la búsqueda de variables en la terminal de Bloomberg y calculando el precio a los distintos plazos estipulados. - Se brindó apoyo en la consolidación de los flujos de deuda externa solicitados por el equipo de Investigación y Desarrollo. - Se realizó Back Up a una integrante del equipo de Investigación y Desarrollo sobre la funcionalidad y actualización de la herramienta de petróleo y se brindó explicación sobre el modelo econométrico que la hace operativa. - Se hizo revisión de los entregables del Pasante del Grupo de Pasivos de la Nación. - Se elaboró un concepto relacionado a Operaciones de Manejo de Deuda para la vigencia 2024. Allí se plasmó el análisis relacionado a la afectación que estas operaciones tiene sobre perfil de vencimientos y se verificó el cumplimiento de la mejora de los indicadores de deuda (vida media, cupón promedio).
- Elaborar los procesos, procedimientos e informes de la Dirección General de Crédito Público y Tesoro Nacional relacionados con los Riesgos Fiscales, asociados a la estrategia de coberturas de petróleo de la Nación y de la Gestión de la Deuda de Mediano Plazo. Avance: - Se elaboraron informes diarios relacionados al comportamiento del mercado de crudo que sintetiza los eventos mas recientes que tienen afectaciones directas al movimiento del precio del Brent – WIT y las posiciones de los agentes que afectan la dinámica de oferta y demanda. Así pues, para la elaboración se obtuvo información a partir de fuentes tales como: Bloomberg, JP Morgan Markets, JP Morgan News, EIA y Reuters. - Se elaboró un informe sobre el comportamiento de la Inversión Extranjera Directa de manera mensual con el objetivo de analizar los saldos de moneda extranjera que han ingresado al país. Así pues, el insumo mediante el cual se realizó el informe fue a partir de la Balanza Cambiaria la cual está disponible en las estadísticas publicadas por el Banco de la República. - Se realizó la actualización del Cupo de Endeudamiento de la Nación correspondiente al mes de diciembre de 2023. En este se tuvo en cuenta el perfil de cierre de deuda

externa para mirar la afectación de cupo de emisión de deuda en dólares y el cupo de garantías disponible de la nación para la vigencia 2024. 4. Se elaboró un concepto relacionado a emisión de bonos pensionales para la vigencia 2024 solicitado por la Subdirección de Financiamiento Interno. Así pues, se procedió con la generación de simulación de escenarios para calcular las referencias óptimas de emisión con el objetivo de evitar el riesgo de refinanciamiento y mejorar la concentración en el perfil de vencimientos de deuda del Gobierno Nacional Central, se brindó recomendación dentro de los intervalos óptimos sugeridos por la Estrategia de Gestión de la Deuda de Mediano Plazo. Posteriormente se radicó y se envió la respuesta a la dependencia. 5. Se realizó el cargue de estadísticas de deuda en la página oficial del Ministerio de Hacienda y Crédito Público mediante la plataforma Oracle Web Services. 6. Se consolidó un concepto de emisión de TES referente al tema de Sentencias y Conciliaciones solicitados por INVIAS. En ese orden de ideas, se procedió con la verificación de la afectación que esta emisión tendría en el perfil de vencimientos de deuda del Gobierno Nacional Central y se dio recomendación los plazos óptimos a emitir dentro de los rangos establecidos por la Estrategia de Gestión de la Deuda de Mediano Plazo. 7. Se consolidó la parte de estadísticas de deuda correspondiente a la presentación del Comité de Pasivos y Coberturas de la Nación número 15 y se asistió presencialmente el Comité en cuestión. 8. Se asistió a junta directiva en donde se discutieron temas relacionados al Plan Financiero 2024. 9. Se asistió a reunión con miembros de la gobernación de Barranquilla para definir la hoja de ruta referente a emisiones en el mercado internacional financiero. 10. Se asistió a reunión con miembros de la Subdirección de Operaciones para discutir temas relacionados a Regalías y Petróleo.
3. Participar en la revisión de los esquemas de valoración que sean requeridos dentro del proceso de mitigación de los riesgos financieros y fiscales, principalmente los asociados a las operaciones financieras de las coberturas de petróleo del Gobierno Nacional Central. Avance: Se asistió a la planeación estratégica de las actividades por desarrollar al interior de la Subdirección de Riesgo durante la vigencia 2024 por parte de los integrantes del equipo de Investigación y Desarrollo en donde se estableció la metodología por mejorar relacionada al programa de Coberturas de Petróleo de la Nación para definir la ventana de entrada y salida al mercado con el objetivo de mitigar potenciales riesgos de mercado. 4. Acompañar a la Dirección, de conformidad con las instrucciones impartidas por el supervisor del contrato, en las discusiones metodológicas con otras entidades y con las dependencias del mismo Ministerio, que surjan del cumplimiento del objeto contractual, de las cuales se deberá dejar el correspondiente registro mediante acta y/o ayuda de memoria. Avance: Cumplido.

5. Realizar consultas y consolidación de información económica en temas relacionados con mercado de renta fija, renta variable, commodities y mercado monetario, entre otros, consolidando bases de datos y estadísticas relacionadas, con el fin de apoyar las tareas propias de la Dirección General de Crédito Público y Tesoro Nacional.

Avance:

1. Se consolidó la base de datos que sirve de insumo para la elaboración del informe mensual del Fondo de Ahorro y Estabilización. En ese orden de ideas, se actualizaron variables económicas tales como: rendimientos de títulos del tesoro, inflación de economías desarrolladas y en desarrollo, índices de capitalización bursátil, índices de producción industrial, rendimientos de TES, tasa de interés de referencia de distintos bancos centrales del mundo, índices de renta variable y fija tales como: MSCI World, Bloomberg US Government, Bloomberg US Government Crédit 1-3 Years, etc.

6. Analizar modelos de inversión y plasmar los resultados en presentaciones e informes, de acuerdo con lo definido en la política de inversión del Fondo de Ahorro y Estabilización – FAE y la normatividad vigente.

Avance:

1. Se asistió a las reuniones mensuales realizadas por las 3 administradoras externas del Fondo de Ahorro y Estabilización en donde se relató por parte de las gestoras la evolución de las inversiones y la atribución del desempeño teniendo en cuenta el comportamiento del mercado. Este informe corresponde a la gestión realizadas por parte de las administradoras durante el mes de diciembre de 2023.

7. Realizar aportes de seguimiento del desempeño del Fondo de Ahorro y Estabilización – FAE, teniendo en cuenta las condiciones generales del mercado de capitales, conforme las políticas establecidas.

Avance:

1. Se elaboró un informe que resume la evolución de los saldos invertidos del portafolio de inversión del FAE en donde se especifica el saldo en tenencia del Banco de la República (en su calidad de administrador) y de las administradoras externas (en su calidad de gestoras en el mercado de capitales). En ese orden de ideas, se presenta la evolución que tuvo el FAE durante el mes de diciembre de 2023.
2. Se elaboró un informe que resume lo informado por parte de las administradoras externas del FAE y su gestión durante el mes de diciembre de 2023.

8. Brindar soporte en el agendamiento de las reuniones periódicas del Grupo Financiero Asesor y el Comité de Inversiones, en cumplimiento de la normatividad vigente.

Avance:

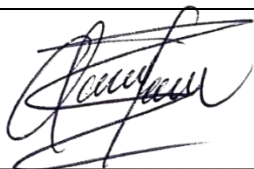
1. Se realizó el Back Up de temas relacionados sobre normativa, gobernanza y estructura de Fondo de Ahorro y Estabilización a una funcionaria del equipo de Investigación y Desarrollo; así mismo, se brindó apoyo para la creación de usuarios para el acceso a la Extranet del FAE y para tener acceso al servidor donde se almacena toda la información sobre saldos, modelos, presentaciones y documentación del FAE.

2. Se gestionó la firma del acta número 54 correspondiente al Comité de Inversiones del FAE y posteriormente se envió al Banco de la República para registros y trazabilidad de la documentación en cuestión. 3. Se gestionó junto con el equipo de la Subdirección de Operaciones en brindar respuesta a una auditoría del Fideicomiso FAE solicitada por el secretario del Comité de Inversiones del FAE.
9. Elaborar informes y presentaciones en inglés relacionadas con el objeto contractual. Avance: - Se elaboró un informe que resume el comportamiento semanal de las tasas de interés de los títulos de deuda pública -TES- emitidos por el MHCP denominados en COP y UVR. - Se elaboró la evolución de deuda trimestral como porcentaje del PIB en inglés.
10. Entregar los informes y documentos generados durante la prestación de sus servicios al Ministerio de Hacienda y Crédito Público, con la periodicidad requerida por el supervisor del contrato. Avance: Cumplido
11. Presentar un informe final en el que se detalle las conclusiones sobre las actividades realizadas.
12. Cumplir con las demás actividades propias de la ejecución del objeto del contrato y que sean asignadas por el supervisor del mismo. Avance: Cumplido.
Productos del contrato Avance: - Presentación en PowerPoint de pronósticos de TRM arrojados por la herramienta de petróleo. - Perfil de deuda Interna al 31 de diciembre de 2023. - Perfil de deuda Externa al 31 de diciembre de 2023. - Perfil de Vencimientos al 31 de diciembre de 2023. - Perfil histórico de deuda e indicadores al 31 de diciembre de 2023. - Informe Trimestral de Deuda como porcentaje del PIB (IV Trimestre 2024). - Concepto de Garantías Bancolombia. - Concepto de Garantías BBVA. - Concepto de Garantías Banco de Bogotá. - Excel de valoración de bonos Yankees. - Flujos de deuda externa al 31 de diciembre de 2023. - Concepto de Operaciones de Manejo de Deuda para 2024. - Informes diarios de petróleo en PDF. - Presentación en PowerPoint de la Evolución de la Inversión Extranjera Directa.

15. Presentación CICP – cupo de endeudamiento y garantías de la nación al 31 de diciembre de 2023.
16. Concepto emisión de Bonos Pensionales para la vigencia 2024.
17. Concepto emisión de TES para Sentencias y Conciliaciones.
18. Presentación en PowerPoint del Comité de Pasivos y Coberturas de la Nación número 15 (apartado de cierre de deuda al 31 de diciembre de 2023).
19. Base de datos Fondo de Ahorro y Estabilización para la elaboración del informe mensual.
20. Presentación en PDF y PowerPoint sobre saldos del FAE y gestión de las administradoras externas durante el mes de diciembre de 2023.
21. Presentación en PDF informe de TES semanal en inglés.

Para la verificación de la información anteriormente relatada puede remitirse al servidor de la Dirección General de Crédito Público y Tesoro Nacional:

1. **SR:\Back up I+D\Grupo I + D\Contrato Andrés Erazo - 3.494-2023\2024\Enero**
2. **FAE:\Llamadas Administradores\2023\12. Diciembre 2023**
3. **SR:\Deuda\Informes\Perfiles\GNC**
4. **SR:\Deuda\Conceptos\Conceptos**
5. **C:\OneDrive - Ministerio de Hacienda\Grupo de Investigación y Desarrollo (I+D)\2024**
6. **SR:\Back up I+D\Herramienta de Petróleo\Archivos a Actualizar Herramienta de Petróleo\Actualizados\2024\Actualización 31-01-2024**



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