



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. 6

DATOS GENERALES DEL CONTRATO

CONTRATO, ORDEN O CONVENIO No.

3

386

2020

BIT O DOCUMENTO IDENTIFICACION CONTRATISTA

1032366588



Radicado: 2-2021-028857

Bogotá D.C., 2 de junio de 2021 14:48

OBJETO DEL CONTRATO, ORDEN O CONVENIO

PRESTAR SERVICIOS PROFESIONALES DE SOPORTE FINANCIERO PARA COLABORAR EN LA ATENCIÓN DE LAS DIFERENTES TAREAS A CARGO DEL MHCP COMO ADMINISTRADOR DEL FONDO NACIONAL DE LAS ENTIDADES TERRITORIALES.

No. Compromisos

184620

FECHA DE SUSCRIPCION DEL CONTRATO, ORDEN O CONVENIO

23/12/2020

NOMBRE CONTRATISTA

CLAUDIA VIVIANA MORALES ROLDAN

VALOR DEL CONTRATO

49,400,000.00

VR DEL CONTRATO MAS ADICIONES

49,400,000.00

VALOR ADICIONES

.00

TOPE MINIMO DE SEGURIDAD SOCIAL

FECHA ACTA DE INICIO:

24/12/2020

I.B.C.

2,400,000

SALUD

300,000

FECHA DE FINAL

31/08/2021

PENSION

384,000

A.R.L.

12,500

VALOR PAGADO: 25,400,000.00

VALOR PENDIENTE POR EJECUTAR: 24,000,000.00

% EJECUCIÓN:

51

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.	6	PERIODO	PAGO DE HONORARIOS DEL MES DE MAYO DE 2021	6,000,000.00	0 %	.00		6,000,000.00
TOTALES					6,000,000.00		.00		
TOTAL A PAGAR									6,000,000.00

PERIODO PAGADO - APORTES SEGURIDAD SOCIAL MAYO DEL AÑO 2021

PLANILLA No.

1037415023

Anexos y No. de Folios

Factura		Cuenta de Cobro		Declaracion juramentada Seguridad Social	1
Otros anexos o Folios	10	Entrada a Almacen		Constancias de pago de la seguridad social	1
Total de Folios Anexos					12

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 Junio del año 2021

SUPERVISORES Y/O INTERVENTORES


FIRMA:

NOMBRE: MARIA VIRGINIA JORDAN QUINTERO

CARGO: DIRECTORA

CEDULA: 67020057

Fecha creación Cumplido 01-06-2021

 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 10

CONTENIDO DEL INFORME

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

CONDICIONES DEL CONTRATO

Número de Contrato:	3.386-2020 del 23 de diciembre de 2020
Nombre del Contratista:	Claudia Viviana Morales Roldan
Periodo informe:	01 al 31 de mayo de 2021
Supervisor:	Dra. Maria Virginia Jordan Quintero
Área perteneciente:	Dirección General de Regulación Económica de la Seguridad Social


1. OBJETO DEL CONTRATO

Prestar servicios profesionales de soporte financiero para colaborar en la atención de las diferentes tareas a cargo del Ministerio de Hacienda y Crédito Público como administrador del Fondo Nacional de Pensiones de las Entidades Territoriales" -FONPET-.

2. OBLIGACIONES DEL CONTRATO, ACTIVIDADES EJECUTADAS Y PRODUCTOS ENTREGADOS

Las obligaciones adquiridas son las siguientes:

1.	<p><i>Apoyar en la elaboración de proyectos de respuesta a los requerimientos de las entidades territoriales relacionados con los temas financieros del FONPET o a solicitudes de información tanto de dependencias al interior del Ministerio como de organismos de control y demás entidades externas</i></p> <p>Avance:</p> <p style="margin-left: 40px;">Se apoyó en el informe de la gestión del Viceministro Técnico, el Dr. Juan Pablo Zarate desde el 30 de septiembre de 2019 al 30 de abril de 2021.</p>
2.	<p><i>Participar en la elaboración de proyectos de actos administrativos relacionados con la administración de los recursos del Fondo y la Auditoría del Fonpet.</i></p> <p>Avance:</p> <p style="margin-left: 40px;">Se apoyó en el ajuste del Artículo 55 de la ley de Mercado de Capitales, el cual quedará de la siguiente manera:</p> <p style="margin-left: 40px;">Artículo 55. Administración del Fondo Nacional de pensiones de las entidades territoriales. Los recursos de los patrimonios autónomos del Fondo Nacional de Pensiones de las Entidades Territoriales (FONPET) y otros patrimonios autónomos públicos destinados a la garantía y pago de pensiones, podrán ser administrados por entidades que se encuentran autorizadas por el</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 10

Gobierno nacional para el efecto y sometidas a la inspección y vigilancia de la Superintendencia Financiera de Colombia.

Los administradores de estos recursos podrán contratar la gestión de los portafolios de inversión a través de gestores locales o del exterior, conforme la reglamentación que expida el Gobierno nacional.

En todo caso, para la realización de las inversiones de estos recursos, los administradores y/o gestores deberán cumplir con los lineamientos fijados por la reglamentación que expida el Gobierno nacional, las cuales deberán tener en cuenta dentro de sus objetivos que la inversión de recursos se realice dentro de un marco adecuado de gestión de riesgo.

3. Realizar seguimiento a los temas financieros y apoyar los temas operativos relacionados con las entidades administradoras de los patrimonios autónomos conformados con los recursos del FONPET y la Auditoría.

Avance:

- Recepción de la información diaria enviada por los consorcios Fonpet2012 y Confiar que corresponde a:
 - Formatos 351 y 468
 - Certificación reserva de estabilización
 - Margen de Solvencia
 - Informe de inversiones y portafolio
 - Informe ETFS Flujo de los rendimientos y comisión fiduciaria
 - Flujo de Caja Portafolio Confiar y Fonpet
 - Comunicaciones de las entidades bancarias con la rentabilidad
 - Comisiones

4. Elaborar informes sobre el comportamiento de los mercados de dinero y de capitales y su impacto sobre los portafolios constituidos con los recursos del FONPET, que incluya entre otros el riesgo financiero del portafolio, para evaluar la gestión realizada por las administradoras de los recursos.

Avance:

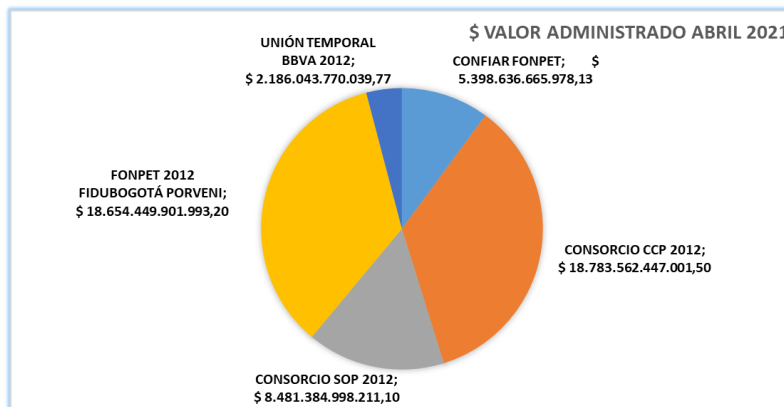
- Se actualizó al mes de abril el Riesgo Financiero del FONPET a través de la herramienta estadística (VAR); el archivo se encuentra disponible en la siguiente ruta:

\\minhacienda\cedin\DGRESS\SSRP\FONPET\AdminRecursos\1 AREA FINANCIERA\4 MERCADOS\SEGUIMIENTO SUPERVISION\Seguimiento_area4_VaR\2021\VAR 2021.xlsx

- El resultado del ejercicio para abril indicó que la probabilidad de pérdida máxima en la administración de los recursos del Fonpet con un nivel de confianza del 99%, en un horizonte de tiempo correspondiente a 10 días sería igual a \$829.881.311.953,37 equivalente al 1,551%.

Valor del Fondo	53.504.077.783.223,70
t	10
Probabilidad	99%
Sigma	0,002108
raiz t	3,16227766
Alpha	2,326347874
VAR PMPE	829.881.311.953,37
Peso	1,551%

- Se actualizó la composición del portafolio a 30 de abril de 2021 el valor del portafolio administrado fue de \$53.5 billones de pesos, distribuidos de la siguiente manera:



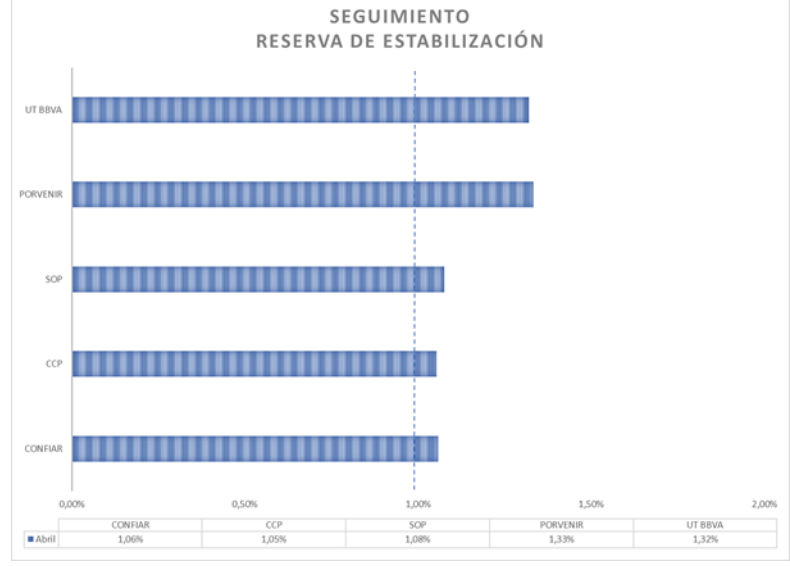
5. Apoyar al seguimiento y control, al cumplimiento de las obligaciones contractuales de los contratos de administración de los recursos del FONPET.

Avance:

Con el fin de garantizar el cumplimiento de las obligaciones contractuales de los contratos de administración:

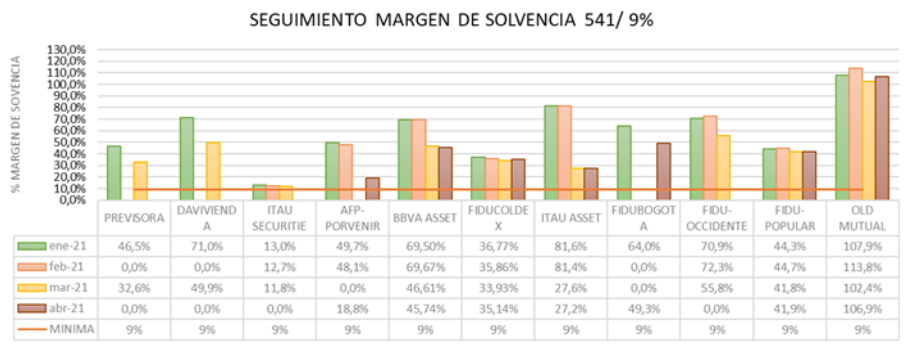
- Se actualizó para el mes de abril la Reserva de Estabilización, se comparó la certificación enviada por las administradoras versus la información que reportan en el SIF. La matriz se encuentra detallada en la siguiente ruta:

\\minhacienda\cedin\DGRESS\SSRP\FONPET\AdminRecursos\1 AREA FINANCIERA\4 MERCADOS\SEGUIMIENTO SUPERVISION\Seguimiento_area\12 Reserva estabilizacion\2021\Seguimiento Reserva de Estabilización. 2021.xlsx



Los 4 consorcios (CCP, SOP, Confiar, Fonpet2012) y la Unión Temporal BBVA enviaron la certificación de la Reserva de Estabilización del mes de abril y se constató que cumplieron con la reserva mínima del 1% que garantiza la rentabilidad mínima.

- Se apoyó en la verificación del Margen de Solvencia para el mes de abril, el control del cumplimiento se encuentra detallado en la siguiente gráfica:




6. Apoyar al seguimiento y control, al cumplimiento de las obligaciones contractuales del contrato de Auditoría.

Avance:

- El día 07 de mayo se llevó a cabo la reunión de supervisión del informe final No 54 de la firma Auditora saliente KPMG Advisory, Tax & Legal S.A.S.
- El día 21 de mayo se llevó a cabo la reunión de supervisión del informe final No 1 de la firma Auditora entrante Amezquita & CIA, al respecto, no se presentó alcance al informe.

7. Participar en las reuniones del Comité Directivo del FONPET, presentar los informes a que haya lugar y preparar para aprobación las actas correspondientes.

Avance:

 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:	5 de 10

El día 19 de mayo se llevó a cabo el segundo Comité Directivo correspondiente a la aprobación de los estados financieros del FONPET del año 2020, al respecto, asistieron los 10 miembros del Comité quienes aprobaron los estados financieros.

Nota: El área financiera está proyectando el acta No 42 para revisión de la Directora de la DGRESS y posterior aprobación por parte del Viceministro Técnico, presidente del Comité.

8. Participar en la estructuración técnica financiera de los procesos de contratación relacionados con la administración de recursos del FONPET.

Avance:

- El día 28 de mayo, se llevó a cabo reunión con el nuevo Viceministro técnico, el Dr. Jesus Antonio Bejarano Rojas, donde la Directora de la DGRESS le presentó los puntos que se venían adelantado con su antecesor, abordando los temas de la siguiente manera:
- Cambios normativos relevantes
- Decreto 444 del 21 de marzo 2020
- Estado actual de los administradores de recursos
- Proyección Otrosí no. 6
- Ampliar el rango de gestores del portafolio.
- Rentabilidad mínima y reserva de estabilización.
- Custodio.
- Contratación consultoría y profesionales.
- Comisión de remuneración.
- Régimen de inversiones.
- Referente de mercado (benchmark).
- Cronograma licitación.
- Bicentenario.

Al respecto, se espera una nueva reunión para la toma de decisiones.

9. Realizar la evaluación técnico financiera de las propuestas presentadas en los diferentes procesos precontractuales a cargo de la DGRESS, coordinando lo pertinente con los funcionarios designados como parte del comité evaluador y la junta de adquisiciones.

Avance:

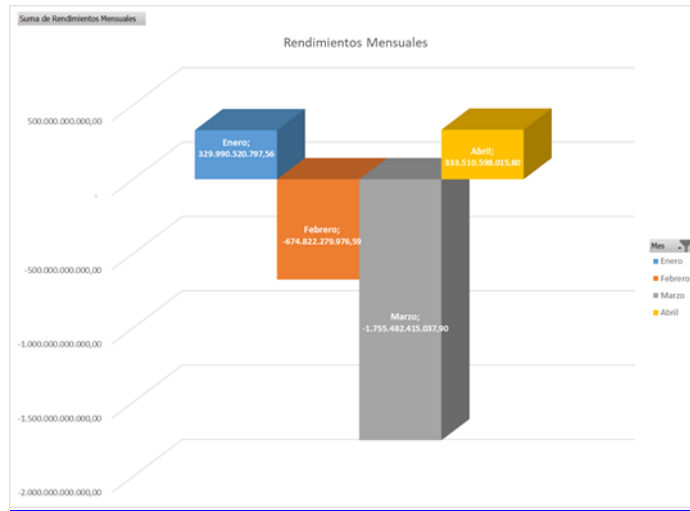
- Se llevará a cabo para los subsiguientes procesos precontractuales.

10. Apoyar al Ministerio en análisis y seguimiento a los diferentes componentes financieros del portafolio, como son los rendimientos de los activos, liquidez, composición de portafolio, coberturas, límites por emisor, entre otros elementos que influyen en la gestión y administración de recursos de FONPET.

Avance:

- Se actualizó la base de datos de los Rendimientos del Portafolio a abril de 2021 con la información disponible en el SIF, el archivo se encuentra en la siguiente ruta:

<\\minhacienda\cedin\DGRESS\SSRP\FONPET\AdminRecursos\1 AREA FINANCIERA\4 MERCADOS\SEGUIMIENTO SUPERVISION\Seguimiento area\9 Rendimientos\2021\Acumulado 2021.xlsx>

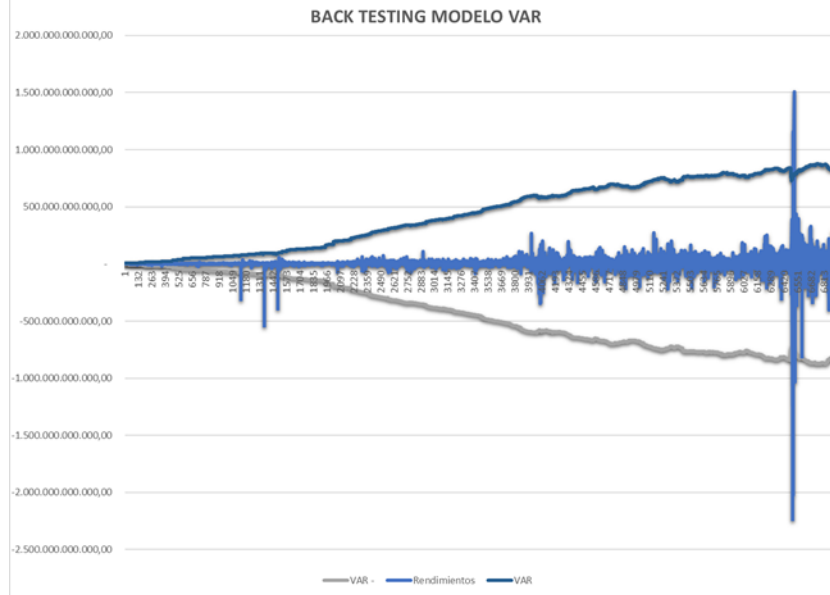


En el mes de abril el FONPET tuvo rendimientos por 333 mil millones, comportamiento provocado por que el mercado de deuda pública local se mantuvo nuevamente influenciado por la estabilización en la dinámica de desvalorización de los tesoros norteamericanos, lo cual a su vez reflejo continuidad de las valorizaciones evidenciadas durante el mes.

11. Participar en la implementación de metodologías de riesgos financieros que permitan realizar seguimiento a los escenarios de impacto para el portafolio del FONPET, en concordancia con el marco legal y financiero vigente.

Avance:

- Se realizó para el mes de abril el Backtesting del Var, donde se comprobó la eficiencia y efectividad del modelo, el cual permite cuantificar el riesgo del Fondo asociado a los rendimientos.



<\\minhacienda\cedin\DGRESS\SSRP\FONPET\AdminRecursos\1 AREA FINANCIERA\4 MERCADOS\SEGUIMIENTO SUPERVISION\Seguimiento area\4 VaR\2021\VAR 2021.xlsx>

No	Fecha de Operacion	Unidad Valorada al	Valor Diario del	Valor Diario
			Fondo al Cierre	Rendimientos
1	12/04/2021	13/04/2021	53.710.033.399.052	- 277.462.789.226
2	22/04/2021	23/04/2021	53.918.285.031.148	- 62.033.560.695
3	26/04/2021	27/04/2021	53.769.379.994.489	- 184.313.067.340
4	27/04/2021	28/04/2021	53.608.584.007.469	- 160.794.534.696
5	29/04/2021	30/04/2021	53.453.127.002.898	- 106.927.287.914

En abril el top 5 de los movimientos atípicos en los rendimientos se dieron por el bajo desempeño de los activos locales que se vieron influenciados por la volatilidad de los mercados.

12. Participar en el proceso de implementación y seguimiento a los sistemas que impacten el seguimiento y control a los contratos de Administración y Auditoría del FONPET.


Avance:

- Se llevaron a cabo pruebas de cargue de información en la herramienta Sofía, con el fin de que se pueda construir el módulo de Analítica de Inversiones, al respecto, se solicitó a los ingenieros hacer unas mejoras para minimizar los tiempos de cargue.

13. Apoyar al Ministerio en el cálculo y análisis de la rentabilidad mínima exigida para determinar si las administradoras de los recursos del FONPET cumplen con ella conforme al Decreto 1861 de 2012 y la carta Circular 71 de la Superfinanciera de Colombia.

Avance:

- El grupo financiero realizó el seguimiento al cálculo la rentabilidad mínima del portafolio en el mes de abril arrojando como resultado el 4.31%; tasa mínima que deben ofrecer los consorcios al FONPET, al respecto en promedio la rentabilidad más alta fue 7.42% de la Unión Temporal BBVA y la más baja en promedio 6.94% del Consorcio SOP.

 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:	8 de 10

14. Recopilar y analizar la información financiera, con el fin de apoyar la proyección de la resolución que autorice la distribución del impuesto de timbre.

Avance:

- Se realizaron validaciones de los recursos pendientes por distribuir a las cuentas de las entidades Territoriales.

15. Apoyar desde la perspectiva financiera, el proceso de modernización y unificación de las herramientas tecnológicas disponibles para optimizar la información y los procesos que se desprenden del seguimiento a la administración de los recursos de FONPET.

Avance:

- Por solicitud de la ingeniera Luz Marina García Sánchez de SOFIA se están cargando diariamente los formatos 351 y 468 enviados por las administradoras para realizar pruebas de cargue masivo con el fin de minimizar la carga operativa del área y analizar el formato final generado por la herramienta SOFIA.

16. Elaborar y Validar informes sobre el cumplimiento del Régimen de Inversión por límites, clases de títulos, emisores, grupos económicos, por inversión en moneda extranjera, límites de cobertura y liquidez, de conformidad a la normatividad vigente.

Avance:

- Se validó el régimen de inversión por grupos económicos, moneda extranjera, cobertura y liquidez


la mayor concentración se encuentra en los títulos emitidos por la Nación del total del Portafolio más liquidez del FONPET, dada la participación del 50% que le permite el régimen de inversión a los títulos de deuda pública.

17. Apoyar al Ministerio en el análisis y validación de los aportes de las entidades territoriales y proyección de los escenarios de acumulación y desacumulación de recursos del FONPET, así como el seguimiento financiero al cubrimiento del pasivo pensional por sector para cada una de ellas, preparando los informes correspondientes.

Avance:

- Se apoyó en la validación y proyección de los escenarios correspondiente al cálculo de los excedentes para el año 2021.

18. Proyectar respuesta a los requerimientos de las dependencias al interior del Ministerio, de los organismos de control y demás entidades externas, relacionados con los aportes, retiros y pasivo de las entidades territoriales y usos de los recursos del FONPET, y participar en la elaboración de los informes y boletines de seguridad social, de conformidad con las directrices definidas por el Ministerio de Hacienda y Crédito Público en calidad de administrador del FONPET.

 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:	9 de 10

<p>Avance:</p> <ul style="list-style-type: none"> Se realizó la revisión de las Columnas 20, 24 33 y 34 del formulario F23.5 - Informe de Ingresos y Gastos con Recursos de Regalías, del mes de abril de 2021, donde se le informó al área de ingresos que en la columna de aportes se encontraron 7 diferencias por decimales.
<p>19. Prestar apoyo en la operatividad y ejecución del software contable con enfoque financiero para el cargue del Formato 351 y 468 (portafolio de inversiones y Derivados).</p> <p>Avance:</p> <ul style="list-style-type: none"> Se están realizando pruebas de cargue de los formatos 351 y 468 de los consorcios FONPET y CONFIAR en el software SOFIA para posteriormente validar el módulo de Analítica.
<p>20. Apoyar en la consecución de información para la elaboración de Notas Contables, con enfoque financiero para acompañar los Estados Financieros del FONPET.</p> <p>Avance:</p> <ul style="list-style-type: none"> Se apoyó en la elaboración del informe del panorama económico para el mes de abril: <p>En el mes de abril la inflación aumento más de lo esperado en estados unidos la cual se esperaba que llegara a una variación anual del 2.5%, no obstante, la variación mensual fue del 0.6%, ubicando la tasa anual en 2.6%; dato que lo ubico como la variación anual más alta desde agosto de 2018. China creció en el primer trimestre en 18,3% se destaca que la mayor parte del crecimiento vino de la mano del sector manufacturero, mientras que el de servicios continúa rezagado como parte de los efectos de la pandemia. En Colombia, el mercado de deuda pública local se mantuvo nuevamente influenciado por la estabilización en la dinámica de desvalorización de los tesoros norteamericanos, lo cual a su vez reflejo continuidad de las valorizaciones evidenciadas durante el mes. La tributaria (Ley de Solidaridad Sostenible) del Ministerio de Hacienda y Crédito Público permitió sembrar un panorama de optimismo en lo que concierne al inicio de los debates. la curva de TES TF presentó una valorización promedio de 6pbs a lo largo de toda la curva, reflejando un comportamiento de aplanamiento. En el caso de las referencias de TES UVR se valorizaron en promedio 5pbs, donde las mayores ganancias se dieron en los títulos con vencimiento en Abr-29 con una disminución de 19pbs. El MHCP subastó en el mercado público de valores colombiano \$1.1 billones en Títulos de Tesorería (TES) denominados en TF en referencias con vencimiento a seis (2027), quince (2036) y veintinueve años (2050). Las tasas de corte fueron 5.944%, 7.317% y 7.779%% respectivamente.</p>
<p>21. Realizar un informe mensual con el avance de la ejecución y cumplimiento de los planes de trabajo y actividades programadas.</p> <ul style="list-style-type: none"> Se realizará y entregará un informe con las actividades desarrolladas en el mes.
<p>22. Realizar un informe final para cierre del contrato con la descripción y resultados de cada una de las actividades realizadas, así como con las respectivas recomendaciones a seguir por cada una de las actividades.</p> <ul style="list-style-type: none"> Se realizará y entregará un informe consolidado una vez culmine el plazo del contrato.

