

Informe de Gestión 2021

1. ANTECEDENTES

- Órgano al que pertenece la UO: Dirección General del Tesoro Público
- Unidad Orgánica que reporta: Dirección de Planificación Financiera y Estrategia.
- Director de la UO: Eduardo Alfonso Olavegoya Hurtado.
- Fecha en la que asumió el cargo: 16/12/2020
- Directivo que lo antecedió: Julio César Córdova Avellaneda.
- Nombre autorizado de la persona para completar el formulario: Eduardo Alfonso Olavegoya Hurtado

2. ESTADO SITUACIONAL AL INICIO DEL EJERCICIO PRESUPUESTAL 2021

Consignar la descripción del estado situacional del órgano / unidad orgánica a su cargo, considerando entre dos a tres rubros por Dirección de Línea. Cada rubro (estado situacional) a describir deberá tener una extensión máxima de 500 caracteres.

- En Ene-21 se aprobó la EGIAP 2021-2024, con un fuerte compromiso con la responsabilidad fiscal y con los lineamientos de gestión financiera; promoviendo una gestión eficiente de los fondos públicos y manejo prudente de la deuda. Los retos y acciones planteadas se enfocaron en: a) fortalecer la gestión de liquidez y tesorería, b) modernizar el Tesoro, c) articular la planificación financiera, d) fortalecer la gestión de la deuda pública, y e) mejorar la gestión de los riesgos fiscales.

3. OBJETIVOS PREVISTOS PARA EL EJERCICIO PRESUPUESTAL 2021

Señalar los objetivos propuestos por el órgano / unidad orgánica a su cargo. Cada campo habilitado para registrar un objetivo tendrá una extensión máxima de 500 caracteres. Tener en cuenta que los Objetivos propuestos tienen que ser sustentados en los siguientes puntos guardando una coherencia y secuencia.

- OBJETIVO 1: Fortalecer la gestión integrada de activos y pasivos.
- OBJETIVO 2: Fortalecer la planificación y programación financiera.

4. ACCIONES DESARROLLADAS PARA EL LOGRO DE OBJETIVOS

Señalar las acciones desarrolladas asociadas a cada objetivo consignado en el numeral precedente. Debe considerar que cada enunciado a colocar debe guardar relación con el objetivo señalado en el numeral previo. Cada rubro (acción desarrollada) tendrá una extensión máxima de 500 caracteres.

- **ACCIONES del OBJETIVO 1:**

Fortalecer la gestión integrada de activos y pasivos: se analizaron los activos y pasivos financieros, subastas del Tesoro, indicadores del mercado de deuda, excedentes de liquidez, Reserva Secundaria de Liquidez, se aprobó la Estrategia de Gestión Integral de Activos y Pasivos 2022-25, entre otros. Se viene implementando los indicadores de riesgos y metodologías de optimización recomendados en la consultoría Fortalecimiento de la Programación Financiera y Planificación Estratégica Multianual.

- **ACCIONES del OBJETIVO 2:**
Fortalecer la planificación y programación financiera: se informó sobre la proyección de ingresos y el seguimiento al financiamiento del presupuesto. Se encuentra en desarrollo un proyecto de metodologías de flujos de caja para el mediano plazo, en el marco del Fortalecimiento de la Planificación y Programación Financiera. Este proyecto permitirá contar con información estandarizada, oportuna y confiable que posibilite una mayor predicción a las proyecciones para las fuentes de financiamiento.

5. DIRECTIVAS/INSTRUMENTOS EMITIDOS DURANTE EL AÑO

- RM N° 031-2021-EF/52 del 23.01.2021
Aprobación de la Estrategia de Gestión Integral de Activos y Pasivos 2021-2024
- RM N° 361-2021-EF/52 del 20.12.2021
Aprobación de la Estrategia de Gestión Integral de Activos y Pasivos 2022-2025
- RM N° 376-2021-EF/52 del 29.12.2021
Aprobación del Reglamento Interno del Comité de Asuntos Fiscales

6. LOGROS OBTENIDOS DURANTE EL PERIODO REPORTADO

Describir los logros obtenidos por el órgano / unidad orgánica a su cargo asociándolos con los objetivos (OEI) y acciones estratégicas institucionales (AEI) del PEI Cada rubro (logro obtenido) tendrá una extensión máxima de 500 caracteres.

- **OEI1 Consolidar el equilibrio Fiscal:** Durante el año 2021, a pesar que el Tesoro Público enfrentó la necesidad de mantener una proporción de los activos mayor a la Reserva Primaria de Liquidez para disponibilidad inmediata y atender los gastos derivados de la pandemia del Covid-19 y reactivación económica, la gestión de rentabilidad de los activos financieros alcanzó el 83,1% sobre el total de activos, superior a la meta de 80,0%.
- **AEI01.08 Priorización del mercado doméstico de valores de deuda pública en soles como principal fuente de financiamiento:** Las necesidades de financiamiento a raíz de la pandemia y de la reactivación económica fueron financiados con el uso de activos, líneas contingentes y emisiones de bonos (principalmente globales); lo cual redujo el porcentaje de la deuda en soles. No obstante, a pesar de las condiciones adversas del mercado, se realizaron emisiones de bonos soberanos por S/ 4 970 millones.

7. ACCIONES PENDIENTES POR DESARROLLAR

Consignar acciones que quedaron pendientes por desarrollar al 31/12/2021 precisando los motivos que justifican dicha situación (Máximo 500 caracteres por acción pendiente)

- Revisar las conclusiones de la consultoría en programación financiera y planificación estratégica multianual para elaborar un plan de requerimientos e implementaciones.
- Diseñar y publicar la Estrategia de Gestión Integral de Activos y Pasivos 2023-2026.
- Desarrollar y aplicar una política de inversiones financieras que permita mantener adecuados niveles de riesgo y retorno, así como una mayor diversificación en instrumentos de inversión, de acuerdo a las mejores prácticas internacionales.
- Actualizar los términos de la Resolución Directoral N°016-2012-EF/52.03 que aprobó los "Lineamientos para la Gestión Global de Activos y Pasivos" y el "Reglamento de Depósitos".

- Implementar las mejoras propuestas al Módulo de Instrumentos Financieros (MIF). Asimismo, se deberá adquirir o desarrollar una plataforma, que empleando la información del MIF, funcione como una herramienta de análisis de gestión integral de activos y pasivos financieros y riesgos financieros la cual ya se vienen afinando los Términos de Referencia.
- Adquirir un software para integrar la planificación financiera con la formulación presupuestal. Previamente se debe diseñar el marco conceptual para sistematizar y establecer las actividades de la estructuración financiera del presupuesto, que permita identificar las fuentes de información y mapear sus flujos y así proponer las características de la herramienta informática que brinde mejoras en el registro y tratamiento de la información para las proyecciones de ingresos y gastos.

FORMATO N° 3
TOTALIDAD DE DOCUMENTOS EMITIDOS SEGÚN CLASIFICACIÓN
(OFICIOS, INFORMES, MEMORANDO, ENTRE OTROS)

TIPO DE DOCUMENTO	TOTAL DOCUMENTOS EMITIDOS
MEMORANDO	164
MEMORANDO CIRCULAR	2
INFORME	92
OFICIO	9
OFICIO CIRCULAR	0
OTROS	0
TOTAL	267

FORMATO N° 5
LISTADO DE PLATAFORMAS DIGITALES O CUENTAS ELECTRÓNICAS: BUZÓN DE SUGERENCIAS, DE CONSULTAS U OTROS, A CARGO DE LA DIRECCIÓN/OFICINA

N°	NOMBRE	TIPO (PLATAFORMA / CUENTA ELECTRONICA)	FINALIDAD	CANTIDAD DE PERSONAS DEL ORGANO / UO AUTORIZADAS PARA ACCESO
1	Bloomberg Finance L.P.	Cuenta electronica	Monitorear el comportamiento del mercado de capitales externo e interno; evaluar de mejor manera las condiciones financieras a las que se enfrenta el país para realizar operaciones de endeudamiento.	1
2	Refinitiv	Cuenta electronica	Monitorear el comportamiento del mercado de capitales externo e interno; evaluar de mejor manera las condiciones financieras a las que se enfrenta el país para realizar operaciones de endeudamiento.	5
3	Portal de Datos Abiertos	Plataforma	Registrar información para el público en general sobre variables importantes del MEF	1
4	Portal Institucional del MEF (versión español e ingles)	Plataforma	Publicar documentos varios elaborados por la Dirección de Planificación Financiera y Estrategia	4
5	SIAF	Plataforma	Permite obtener las bases de datos de los cuentas del Tesoro en el BCRP y BN, el cual es empleado para el análisis de activos y análisis integral de activos y pasivos financieros. También, permite obtener información de ejecución de flujos de ingresos de la CUT (RDR, DyT, ROOC proyectos y RD), flujos de egresos, saldos bancarios y saldos de deuda flotante, para el seguimiento de las proyecciones. Asimismo, brinda información para el análisis de reportes de desembolsos mensuales, establecer proyecciones para determinación del flujo de excedentes y para ver saldos de bancos en cuentas corrientes, seguimiento de saldos.	4
6	SIAD	Plataforma	Comprende las simulaciones de la Deuda Pública a partir de la cual se obtiene los saldos de la deuda (bajo distintas clasificaciones) y de sus flujos de amortizaciones e intereses que permiten el análisis de la posición y perfil de la deuda, y análisis integral de activos y pasivos financieros. Además, permite identificar créditos y bonos plausibles para formar parte de una operaciones de administración de deuda.	6
7	MIF	Plataforma	Permite obtener la base de datos de los saldos y características los de activos y pasivos financieros de las entidades del Sector Público, permite el análisis y seguimiento de los activos del SPNF, análisis integral de activos y pasivos financieros, preparación de información y reporte para el Comité de Caja y atención a diversas consultas relacionadas.	5