

DIRECCIÓN DE TESORERÍA INTERNACIONAL Y DERIVADOS**Objetivo.**

Formular las estrategias de operación de instrumentos derivados, de la tesorería en moneda extranjera y de los préstamos de Organismos Multilaterales y Bilaterales que permitan alcanzar los objetivos aprobados por el Consejo Directivo, así como controlar la ejecución de las mismas y evaluar su desempeño. Proponer estrategias para optimizar el margen y los riesgos de balance financiero de la Institución y diseñar soluciones para necesidades específicas de financiamiento vía mercados u operaciones estructuradas.

Vigilar el cumplimiento de las obligaciones de la Institución en su carácter de Agente Financiero del Gobierno Federal.

Supervisar la elaboración y difusión de estudios de análisis macroeconómico y de los mercados financieros, así como la formulación de estrategias para la optimización de las carteras de valores.

Funciones.

- a) Coordinar la formulación de las propuestas que deban ser sometidas a la aprobación del Órgano Colegiado competente en materia de operaciones derivadas, para autorización de los instrumentos, subyacentes, objetivos, metas y procedimientos generales, así como de nuevos productos.
- b) Coordinar la implementación de nuevos productos derivados dentro de la Institución, así como el diseño y la ejecución de estrategias de operación de instrumentos derivados que tengan como objeto, entre otros, proveer coberturas de riesgos, disminuir el costo de financiamiento o aumentar la rentabilidad de activos de la Institución, incluyendo la obtención de las aprobaciones necesarias de las instancias competentes, la ejecución de las operaciones y el seguimiento de los resultados.
- c) Coordinar el diseño de estrategias de operación para gestionar las operaciones en moneda extranjera (activos, pasivos y operaciones cambiarias), así como dar seguimiento a la ejecución de las acciones acordadas.
- d) Coordinar las relaciones con las áreas encargadas de la estructuración y operación de instrumentos derivados, operaciones cambiarias y de tesorería internacional en otras instituciones financieras, para procurar que la Institución tenga acceso a los productos apropiados para el logro de sus objetivos.
- e) Establecer los requerimientos que debe satisfacer la infraestructura técnica de la Institución en materia de instrumentos derivados y de las operaciones de la Tesorería Internacional (modelos, métodos, procesos y sistemas).
- f) Establecer las directrices para la negociación de contratos marco para la realización de operaciones derivadas y operaciones cambiarias.
- g) Establecer las directrices a seguir en la formulación de estrategias de desembolsos, conversiones de moneda y reestructuraciones de los préstamos de los Organismos

Multilaterales y Bilaterales, así como en la ejecución de dichas estrategias.

- h) Establecer las directrices para la negociación de los contratos que se celebren con Organismos Multilaterales y Bilaterales incluyendo las autorizaciones respectivas.
- i) Diseñar, proponer y ejecutar estrategias de gestión de balance para mitigar los riesgos financieros de la Institución.
- j) Establecer el marco para la determinación del costo marginal de financiamiento de los activos que se fondean y cuyo riesgo de mercado se administra en el Comité de Administración de Activos y Pasivos.
- k) Establecer el marco de análisis macroeconómico y de los mercados financieros, determinar las variables clave para el seguimiento de éstos y supervisar la producción y distribución de los estudios respectivos.
- l) Dirigir las acciones para realizar informes, estudios y análisis respecto de las actividades realizadas, los resultados obtenidos y las acciones propuestas, para someterlos, en su caso, a las instancias facultadas.
- m) Dirigir y ejecutar las acciones y actos que se le atribuyan en los manuales relacionados con Procesos, Políticas y Procedimientos y otros emitidos por las distintas instancias para la operación de la Institución, FOVI y SCV-SHF.
- n) Gestionar la elaboración, cambios o modificación del (los) Manual(es) de Procesos, Políticas y Procedimientos que apliquen en el ámbito de su competencia.
- o) Dirigir y coordinar las acciones del personal a su cargo, para cumplir con lo establecido en el Programa Institucional, así como con todas las disposiciones normativas aplicables, para mejorar el desempeño de su función y de la Institución.
- p) Integrar y proporcionar información requerida por las áreas de SHF y autoridades administrativas competentes, para efectos de planeación, programación, seguimiento, control, evaluación, transparencia y rendición de cuentas.
- q) Integrar, validar y enviar, en tiempo y forma, los reportes regulatorios que le correspondan, en el ámbito de su competencia.
- r) Dirigir la operación y conservación del archivo a su cargo de conformidad con la normatividad aplicable en la materia.
- s) Dar atención y cumplimiento a los requerimientos y observaciones de las auditorías internas, externas y de autoridades regulatorias, así como las disposiciones de control interno que le competan.
- t) Las demás que le sean encomendadas por las instancias competentes, la Dirección General Adjunta a la que esté adscrito y la normatividad vigente.