

INFORME N° 0006-2011-GTI240

PARA: **Señor Leandro Alvarez**
Subgerente de Servicios TI (i)

Felipe Roel
Gerente de Tecnologías de Información

Leandro Alvarez Figueroa
Sub-Gerente de Servicios de
Tecnologías de Información (i)

ASUNTO: **Estandarización del Software Eviews**

1. NOMBRE DEL ÁREA:

Subgerencia de Servicios de Tecnologías de Información

2. RESPONSABLE DE LA EVALUACIÓN:

Leandro Alvarez Figueroa
Silvia Huasipoma Casas
Julio Rivera Zárate

3. CARGOS:

Subgerente (e) de Servicios De Tecnologías de Información
Jefe del Departamento de Gestión y Calidad
Especialista en Gestión de Tecnologías de Información

4. FECHA:

2011-01-25

5. DESCRIPCIÓN DEL EQUIPAMIENTO O INFRAESTRUCTURA PREEXISTENTE:

Se cuenta con 90 licencias del software Eviews, con servicio de mantenimiento y soporte técnico, las mismas que se encuentran instaladas en la plataforma informática del Banco.

6. DESCRIPCIÓN DEL BIEN O SERVICIO REQUERIDO:

El mantenimiento y soporte técnico de las licencias del software Eviews. Dicho software es utilizado para el desarrollo de modelos econométricos(financieros y económicos), el análisis estadístico, la proyección de variables económicas y financieras, así como la realización de modelos de simulación. El mantenimiento garantiza que las nuevas versiones del software estén disponibles y puedan ser instaladas a los usuarios. Asimismo el soporte técnico provee asistencia técnica en casos de problemas presentados durante el trabajo con el software.

7. USO O APLICACIÓN:

Gerencia Central de Estudios Económicos:

El software Eviews es considerado como imprescindible y es usado intensivamente en las investigaciones realizadas en la Gerencia Central de Estudios Económicos. Algunas de sus aplicaciones son:

- Análisis de series temporales en modelos multiecuacionales de los efectos de la política monetaria. Incluye pruebas de raíces unitarias y de cointegración, evaluación de los residuos del modelo y análisis de proyecciones.
- Estudios de datos de panel para la evaluación de los efectos de hoja de balance de la dolarización financiera.


2135 / 1152

001610



* I N F O R M E 0 0 0 6 - 2 0 1 1 - G T I 2 4 0 *


Julio Rivera Zárate
Reg. 1990


SILVIA HUASIPOMA CASAS
Jefa, Dpto. Gestión y
Calidad

- Programación de rutinas de pruebas de raíces unitarias con quiebres estructurales en modelos de predicción de la inflación.
- Descomposición de los componentes de ciclos y tendencias de las series de inflación, producto y tasas de interés.
- Estimación de modelos de heterocedasticidad condicional en las variables financieras monetarias como la inflación, las tasas de interés y el tipo de cambio.

Gerencia de Operaciones Internacionales:

En la Gerencia de Operaciones Internacionales, el software Eviews, es imprescindible en el desempeño de las funciones de las distintas áreas que componen dicha Gerencia.

Para la Subgerencia de Análisis de Inversiones Internacionales, éste software contribuye con el análisis estadístico y econométrico de los reportes y estudios encargados a ésta área, como son:

- Realizar estimaciones de modelos de varianza condicional para la utilización en el calculo de medidas de riesgo como el VaR.
- Efectuar simulaciones para modelos de optimización media –varianza de los distintos tramos del portafolio.
- Desarrollar temas de investigación en temas de medición de Riesgo y Desempeño que puedan ser implementados.

Para la Subgerencia de Gestión de Inversiones Internacionales, las licencias Eviews asignadas se utilizan en los Departamentos de Gestión de Portafolios Líquidos (DGLP) y de Gestión de Portafolios de Inversión (DGPI). En el caso del DGPI se usan para el análisis de series financieras, tanto cronológicas cuanto de tipo de activo, así como para la ejecución de pruebas de causalidad y modelos econométricos y de probabilidad que son utilizados para el mejor desempeño de las distintas carteras de inversión.

Por su parte el DGPI estima, a través de un modelo de Logia-Probit en Eviews, posibles movimientos de la pendiente en la curva de rendimientos en el sector mediano de la curva. Asimismo, cuenta con un modelo de Tracking-error que usa estimaciones provenientes de modelos econométricos desarrollados en Eviews y se utiliza las funcionales ARCH y GARCH para elaborar modelos de volatilidad de los distintos instrumentos de inversión. Finalmente, el Eviews es constantemente usado por los analistas del Departamento para evaluar y predecir el comportamiento y relaciones de los distintos instrumentos financieros en los que invierte el Banco Central y las posibles alternativas de inversión.

Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera:

Las labores que se realizan en la Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera, hacen que la disponibilidad de este software, por parte de los especialistas, sea necesaria. Dentro de las labores que requieren el uso de este software destacan:

- Informes regulares de los Departamentos: Reporte de Estabilidad Financiera (análisis estadístico de variables económicas y financieras, proyección de variables, entre otros). Informe mensual de situación del sistema financiero, (análisis de tendencia y estacionalidad de variables financieras, actualización

2135 / 1152

001610



* I N F O R M E O 0 0 6 - 2 0 1 1 - G T I 2 4 0 *

Julio Rivera Zárate
Reg. 1990

SILVIA HUASIPOMA CASAS
Jefa, Dpto. Gestión y
Calidad

de proyecciones de variables tales como los indicadores de cartera morosa, entre otros).

- Informes especiales: continuamente, esta Gerencia recibe pedidos especiales, que requieren la estimación de algún modelo econométrico.
- Investigación: requieren el uso intensivo del software Eviews.
- Plan Estratégico 2011: las actividades estratégicas incluyen la estimación de modelos econométricos – financieros para evaluar el costo del crédito; para identificar las regularidades empíricas del Sistema Bancario Peruano; para cuantificar el riesgo de crédito, en las colocaciones de consumo y MES, usando modelos de proyección de morosidad; y, para un modelos de proyección de los depósitos del Sistema Bancario.

Gerencia de Gestión del Circulante:

En la Gerencia de Gestión del Circulante, el software Eviews, es imprescindible en el desempeño de las funciones del personal que tienen instalado las licencias.

El personal del Departamento de Programación del Circulante, utiliza el software para cumplir con las funciones asignadas en el Departamento, tales como: determinación de los requerimientos de aprovisionamiento de billetes y monedas, así como perfeccionar las técnicas para la estimación de los requerimientos de billetes y monedas.

Subgerencia de Sucursales:

La Subgerencia de Sucursales, manifiesta que el software Eviews es imprescindible para el desempeño de las funciones propias del Departamento de Estudios Económicos en Sucursales.

Indican que en la actualidad se desarrollan modelos de predicción de la producción agrícola de los principales cultivos de las regiones y modelos sobre el impacto de las variables climatológicas sobre las variables reales. Esto permitirá anticipar a la Gerencia de Información y Análisis Económico sobre impactos probables de shocks tales como el fenómeno del Niño y otros.

8. JUSTIFICACIÓN:

En cumplimiento de la Directiva Nro. 10-2009-OSCE/CD, a continuación se sustentan los requisitos para proceder a la estandarización:

- a. La Entidad posee determinado equipamiento o infraestructura pudiendo ser maquinarias, equipos, vehículos, u otro tipo de bienes, así como ciertos servicios especializados.**

El Banco cuenta con 90 licencias del software Eviews, las mismas que se encuentran instaladas en la plataforma informática del Banco.

- b. Los bienes o servicios que se requiere contratar son accesorios o complementarios al equipamiento o infraestructura preexistente.**

La renovación del mantenimiento y soporte técnico de las licencias del software Eviews, son complementarias para el funcionamiento de las licencias. Asimismo, posibilitará a los usuarios, contar con el soporte técnico y las últimas versiones del software, en forma oportuna.

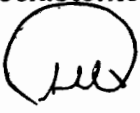
- c. Los bienes o servicios que se requiere contratar son imprescindibles para garantizar la funcionalidad, operatividad o valor económico del equipamiento o infraestructura preexistente.**

2135 / 1152

001610



* I N F O R M E O 0 0 6 - 2 0 1 1 - G T I 2 4 0 *


Julio Rivera Zárata
Reg. 1990


SILVIA HUASIPOMA CASAS
Jefa, Dpto. Gestión y
Calidad

La importancia de esta herramienta y su estandarización es alta, dada la utilidad que proporciona a los Especialistas de las Gerencias de: Central de Estudios Económicos, Operaciones Internacionales, Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera, Gestión del Circulante, así como la Subgerencia de Sucursales, en el desempeño de sus funciones.

Asimismo, es utilizado para el desarrollo de modelos econométricos (financieros y económicos), el análisis estadístico, la proyección de variables económicas y financieras, así como la realización de modelos de simulación, los cuales son usados en la evaluación de la política monetaria y de la proyección de la inflación que realiza esta Institución. Específicamente se utiliza para: desarrollar, estimar e implementar modelos estadísticos y econométricos; elaboración sistemática de procesos de desestacionalización de variables monetarias mediante métodos Arima X-12 y Tramo-Seats, útiles en la proyección de variables relacionadas con la actividad económica; la estimación de variables que determinan los flujos de comercio, principalmente a partir de los test de raíces unitarias e impulsos respuesta. En tal sentido, los usuarios manifiestan que es una herramienta de carácter imprescindible.

9. CONCLUSIONES:

A fin de mantener la actualización tecnológica que permita la continuidad de las labores de investigación y desarrollo de modelos que realiza esta institución, a lo que añadimos el mejor aprovechamiento de la experiencia en el uso de las funcionalidades del software Eviews, parte de los usuarios de las Gerencias de: Central de Estudios Económicos, Operaciones Internacionales, Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera, Gestión del Circulante, así como la Subgerencia de Sucursales, se recomienda su estandarización.

De acuerdo con el artículo 11° del Reglamento de la Ley de Contrataciones del Estado, se solicita se apruebe la estandarización del software Eviews en el proceso de Renovación del mantenimiento y soporte técnico de licencias del software Eviews.

Atentamente,

Julio Rivera Zárate
Reg. 1990

SILVIA HUASIPOMA CASAS
Jefa. Dpto. Gestión y
Calidad

Departamento de Gestión y Calidad

25 de enero de 2011

