

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

MEMORANDO N° 0298-2013-ADM100

A : Señor José Arturo Alberto Pastor Porras
Gerente de Compras y Servicios

DE : Javier Ricardo Gutiérrez González
Subgerente de Logística

ASUNTO : Estandarización del software Matlab

FECHA : 21 de octubre de 2013

JAVIER OLIVERA VEGA
Gerente Central de Administración

ARTURO PASTOR PORRAS
Gerente de Compras y Servicios

Por medio del presente solicito a usted se sirva elevar a la Gerencia Central de Administración para su aprobación el Informe N° 0092-2013-GTI240, elaborado por el Departamento de Gestión y Calidad, de la Subgerencia de Servicios de Tecnologías de Información, referido a la estandarización para la renovación por un año del servicio de mantenimiento y soporte técnico del software Matlab.

De acuerdo con lo indicado en el informe, el Banco cuenta con 26 licencias del software Matlab instaladas en la plataforma informática del Banco, las que son utilizadas por los técnicos de la Gerencia de Política Monetaria, Subgerencia de Investigación Económica, Gerencia de Información y Análisis Económico y Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera, en el desarrollo de modelos econométricos y matemáticos avanzados.

Se menciona en el informe que se requiere contratar el servicio de mantenimiento y soporte técnico con el fin de que estén disponibles las nuevas versiones del software y puedan ser instaladas a los usuarios, así como para contar con asistencia técnica en caso se presenten problemas durante el trabajo con el software.

En tal sentido, considerando que el Banco es propietario de 26 licencias del software Matlab, es decir que se trata de un bien preexistente, y que la renovación del mantenimiento y soporte técnico es complementaria con la infraestructura existente e indispensable para garantizar la vigencia tecnológica del software, se concluye que la solicitud planteada por el Departamento de Gestión y Calidad de la Subgerencia de Servicios de Tecnologías de Información se enmarca en el proceso de estandarización previsto en el Artículo 11 del Reglamento de la Ley de Contrataciones.

La presente estandarización tendrá vigencia durante el proceso de selección que se lleve a cabo para la contratación del servicio de mantenimiento y soporte técnico para las 26 licencias del software Matlab.

Atentamente,

Banco Central de Reserva del Perú Gerencia Central de Administración
12 DIC. 2013
RECIBIDO
Hora:..... N° Reg:.....

Página 1 de 1

1318 / 1877

021812



* MEMORANDO 0298 - 2013 - ADM 100 *

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

MEMORANDO N° 0115-2013-GTI200

A : Señor Javier Ricardo Gutiérrez González
Subgerente de Logística

DE : Miguel Ángel Tejada Malaspina
Subgerente de Servicios de Tecnologías de Información

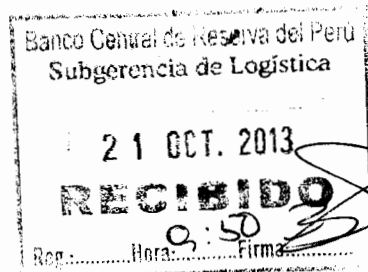
ASUNTO : Estandarización del Software Matlab

FECHA : 17 de octubre de 2013

Por medio del presente, sírvase encontrar adjunto el informe No. 0092-2013-GTI240 elaborado por el señor Julio Rivera, sobre la estandarización del Software Matlab, para los fines pertinentes.

Atentamente,


MIGUEL TEJADA MALASPINA
Subgerente de Servicios de
Tecnologías de Información



2177 / 1152

021693



* MEMORANDO 0115 - 2013 - GTI 200 *

Página 1 de 1

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

INFORME N° 0092-2013-GTI240

PARA: Señor Miguel Tejada
Subgerente de Servicios TI

ASUNTO: Estandarización del Software Matlab

Felipe Roel Montoya
Gerente de Tecnologías de Información

1. NOMBRE DEL ÁREA:

Subgerencia de Servicios de Tecnologías de Información

2. RESPONSABLE DE LA EVALUACIÓN:

Miguel Tejada Malaspina
José Cáceres Torres
Julio Rivera Zárate

MIGUEL TEJADA MALASPINA
Subgerente de Servicios de
Tecnologías de Información

3. CARGOS:

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

4. FECHA:

2013-10-17

5. DESCRIPCIÓN DEL EQUIPAMIENTO O INFRAESTRUCTURA PREEXISTENTE:

Se cuenta con 26 licencias del software Matlab, 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:

La renovación del mantenimiento y soporte técnico de las 26 licencias del software Matlab por 01 año. Dicho software es utilizado para el desarrollo de modelos econométricos y matemáticos. 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:

Subgerencia de Investigación Económica:

✓ La subgerencia de Investigación Económica utiliza modelos econométricos y matemáticos avanzados para analizar los efectos de la política económica en general y de la política monetaria del Banco Central en particular. Utilizando los resultados de este análisis, la subgerencia elabora y proporciona sugerencias técnicas respecto a las políticas óptimas que podría seguir el Banco. Para desarrollar, estimar e implementar estos modelos mencionados es indispensable el uso intensivo de Matlab.

✓ Asimismo, estos modelos son similares a los de otros bancos centrales de países desarrollados y de países en desarrollo. En este sentido, la interacción

2097 / 1152

021677



* I N F O R M E 0 0 9 2 - 2 0 1 3 - G T I 2 4 0 *

Julio Rivera Zárate
Reg 1990

Página 1 de 4

José Cáceres Torres
Jefe, Dpto. Gestión y
Calidad

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

técnica entre bancos centrales también se realiza a través del lenguaje técnico de las aplicaciones de Matlab.

- ✓ Por ejemplo, las rutinas construidas para modelos dinámicos estocásticos de equilibrio general (DSGE, por sus siglas en inglés) están programadas en Matlab. El desarrollo de este tipo de modelos es parte central de la agenda de investigación de nuestra subgerencia, por lo que su implementación requiere que sea compatible con modelos de similar naturaleza, de manera que sea posible usar los códigos programados por otros investigadores.
- ✓ En particular, el Matlab permite realizar a los miembros de la subgerencia las siguientes actividades:
 - Simulación estocástica y resolución de modelos de expectativas racionales. Esto sólo se puede implementar mediante el uso de Matlab, pues permite desarrollar cálculos estocásticos.
 - Evaluar la capacidad de predicción de los modelos. Esto sólo se puede implementar con Matlab pues contiene componentes estadísticos para predecir series de tiempo (statistics toolbox, garch toolbox, symbol math toolbox, entre otros).
 - Obtener sendas óptimas de comportamiento de política. Matlab facilita el empleo de métodos de optimización, los cuales manualmente son imposibles de realizar (por ejemplo, optimization toolbox, control system toolbox, financial toolbox, entre otros).

Gerencia de Política Monetaria:

El uso del software Matlab es esencial para el cumplimiento de las principales tareas de la Subgerencia de Diseño de Política Monetaria, en particular de la elaboración de proyecciones macroeconómicas y de escenarios de política monetaria, a cargo del Departamento de Modelos macroeconómicos, y del seguimiento diario de los mercados de dinero domésticos y externos a cargo del Departamento del Programa Monetario.

Se realizan las siguientes actividades:

- ✓ Simulación estocástica y resolución de modelos de expectativas racionales.
- ✓ Estimación de los parámetros de los mismos.
- ✓ Evaluación de sus capacidades de predicción.
- ✓ Estimación de la curva de rendimiento.

Gerencia de Información y Análisis Económico:

La Gerencia de Información y Análisis Económico manifiesta que la renovación de este software será de gran utilidad para el trabajo que desempeñan.

Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera:

Dentro de los objetivos estratégicos del Banco Central de Reserva del Perú, es contribuir con la estabilidad financiera y el desarrollo del mercado de capitales. En este contexto, la Subgerencia de Análisis del Sistema Financiero y del Mercado de Capitales realiza de manera continua, informes técnicos y de investigación, asimismo utiliza modelos econométricos y matemáticos avanzados para analizar los efectos de las políticas del Banco Central de Reserva del Perú.

2097 / 1152

021677



* I N F O R M E O 0 9 2 - 2 0 1 3 - G T I 2 4 0 *

Julio Rivera Zarate
Reg 1990

Página 2 de 4

José Cáceres Torre
Jefe, Dpto. Gestión y
Calidad

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

Gerencia de Operaciones Internacionales:

La subgerencia de Gestión de Inversiones Internacionales, manifiesta lo siguiente:

- ✓ El software Matlab se utiliza para aplicaciones estadísticas, financieras y de optimización que soportan el proceso "5.5 Diseño de Estrategias de Inversión" para los portafolios del Banco. Asimismo, el diseño de programas en el ambiente de Matlab permite la programación de modelos, manejo de bases de datos, formulación de escenarios y la visualización gráfica de los resultados en un tiempo menor que cualquier otro software. Ello se debe a que a diferencia de otros programas, el matlab ofrece módulos (toolboxes) que contienen programas matemáticos específicos que son usados en los modelos de la Subgerencia, facilitando así la programación.

La subgerencia de Análisis de Inversiones Internacionales, manifiesta lo siguiente:

- ✓ El MatLab nos permite acelerar el desarrollo de modelos internos aplicables a la gestión del portafolio y la medición de su desempeño.
- ✓ A nivel general es un software de algoritmos abiertos, los cuales pueden ser modificados para que se pueda personalizar cualquier modelo a la realidad del portafolio y la medición de sus riesgos asociados. Es muy flexible en el manejo de la data mediante sus Toolboxes Spreadsheet Link Ex(for Microsoft Excel), Database Toolbox y Matlab Builder EX – Builder for Excel, ya que puede acceder bidireccionalmente a libros de trabajo de Microsoft Excel y permite crear Add-Ins en Excel para que el resto de usuarios puedan correr modelos en sus estaciones sin la necesidad de tener Matlab instalado.
- ✓ Las funciones del Optimization ToolBox permiten obtener el óptimo para modelos con y sin restricciones de variables discretas o continuas. Además posee múltiples métodos numéricos de optimización, lo cual hace de MatLab una herramienta robusta en términos de cálculo.

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 26 licencias del software Matlab, con servicio de mantenimiento y soporte técnico, 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.**

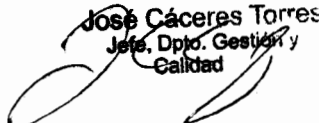
La renovación del mantenimiento y soporte técnico de las 26 licencias del software Matlab, es complementaria para el funcionamiento de las licencias, debido a que posibilitará a los usuarios contar con el soporte técnico y las últimas versiones del software en forma oportuna.

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

La importancia de esta herramienta y su estandarización es alta, dada la utilidad que proporciona a los Especialistas de las Gerencias de Política Monetaria, Operaciones Internacionales, Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera,




Julio Rivera Zarate
Reg 1990


Jose Cáceres Torres
Jefe. Dpto. Gestión y
Calidad

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

Información y Análisis Económico, así como en la Subgerencia de Investigación Económica, en el desempeño de sus funciones. 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 MatLab y sus componentes por parte de los usuarios de las Gerencias de Política Monetaria, Operaciones Internacionales, Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera, Información y Análisis Económico, así como en la Subgerencia de Investigación Económica, 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 MatLab en el proceso de Renovación del mantenimiento y soporte técnico de licencias del software MatLab.

Atentamente,



Julio Rivera Zarate
Reg. 1990



José Cáceres Torres
Jefe, Dpto. Gestión y
Calidad

Departamento de Gestión y Calidad

17 de octubre de 2013

