

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

INFORME TÉCNICO PREVIO DE EVALUACIÓN DE SOFTWARE No.0003-2014-GT1000

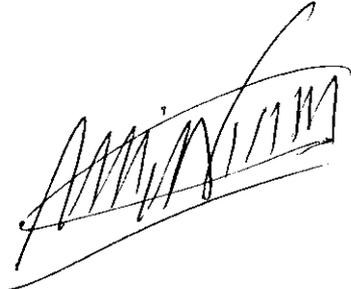
Renovación del Mantenimiento y Soporte Técnico del Software EViews

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

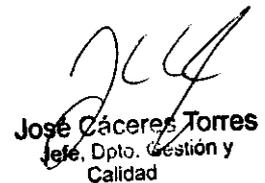


3. CARGOS:

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

4. FECHA:

2014-01-22



José Cáceres Torres
Jefe, Dpto. Gestión y
Calidad

5. JUSTIFICACIÓN:

Gerencia Central de Estudios Económicos:

El software Eviews es considerado como imprescindible y es usado intensivamente en las investigaciones e informes realizados 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.
- 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 cálculo de medidas de riesgo como el VaR.

2174 / 1152001507



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



Página 1 de 4

Julio Rivera Zárate
Especialista en Gestión y Calidad

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

- 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 en el Departamento.

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) y de Análisis Táctico de Inversiones Internacionales. En el caso del DGPL 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 Logit-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. Finalmente, este paquete será utilizado por el nuevo departamento de Análisis Táctico de Inversiones Internacionales, encargado de diseñar y dar mantenimiento a los modelos cuantitativos que respaldan las estrategias de inversiones de los portafolios.

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 que elabora y supervisa informes técnicos y de investigación, sea necesaria é imprescindible.

Dentro de las labores que requieren el uso de este software destacan:

- Informes regulares tales como: (i) Reporte mensual del Sistema Financiero (análisis de tendencia y estacionalidad de variables financieras, proyección de variables financieras, entre otros); (ii) Reporte semanal del Mercado de Capitales (estimación y ajuste de curvas de rendimiento, entre otros); y (iii) Reporte de Estabilidad Financiera (análisis estadístico de variables económicas y financieras, actualización de proyecciones de variables tales como los indicadores de morosidad, entre otros).
- Informes específicos solicitados por la Alta Dirección, muchos de los cuales requieren la estimación de algún modelo econométrico.
- Elaboración de documentos de investigación en temas de interés para el Banco referidos al sistema financiero y el mercado de capitales, que forman parte de las actividades del plan estratégico.

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.

2174 / 1152001507



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


Julio Rivera Zárate
Especialista en Gestión y Calidad

Página 2 de 4


José Cáceres Torres
Jefe, Dpto. Gestión y
Calidad

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

Manifiestan que para cumplir con las funciones asignadas a esta Gerencia, entre las cuales se tiene el abastecer a la economía de billetes y monedas en las cantidades y denominaciones requeridas en forma oportuna, se requiere el software Eviews para desarrollar las técnicas econométricas y estadísticas que nos permitan estimar adecuadamente la demanda por numerario.

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 las Sucursales.

Entre las múltiples aplicaciones del software Eviews, destacan las siguientes:

- Análisis de series temporales de las principales variables reales a nivel regional, destacando en particular las correspondientes a la producción de los sectores económicos y la inversión pública y privada. Además de la obtención de los indicadores estadísticos convencionales, se realizan pruebas de causalidad y pruebas de raíces unitarias y de cointegración.
- Descomposición de los componentes de ciclos y tendencias de las series de producto de los sectores económicos a nivel regional.
- Estimación de modelos de heterocedasticidad condicional en las variables financieras a nivel regional.
- Aplicaciones estadísticas para el procesamiento de encuestas y bases de datos en general.

6. ALTERNATIVAS:

Actualmente se utiliza el Software Eviews como herramienta para ejecutar todas las aplicaciones nombradas en el punto anterior, por lo que se encuentra estandarizado.

7. ANÁLISIS COMPARATIVO TÉCNICO:

Dado que es un producto que ya se viene usando en el Banco, desde el año 2002, y por lo cual se encuentra estandarizado, lo que se desea es la renovación del mantenimiento y soporte técnico de las Licencias. En tal sentido, no cabe un análisis comparativo técnico, sólo se realizará una evaluación de los servicios adicionales que ofrezcan los diferentes proveedores.

8. ANÁLISIS COMPARATIVO DE COSTO – BENEFICIO:

Costos:

Costos asociados al producto incluyen:

➤ Renovación de Licencias

- 60 licencias del software Eviews Enterprise 8.0, con fecha de renovación desde el 19 de Abril del 2014 al 19 de Abril del 2015.
- 35 licencias del software Eviews Enterprise 8.0, con fecha de renovación desde el 13 de Noviembre del 2014 al 13 de Noviembre del 2015.

El precio referencial por la renovación de dichas licencias por un año, es de S/. 70 650,00 incluidos los impuestos de ley.

➤ Hardware necesario para su funcionamiento

2174 / 1152001507



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


Julio Rivera Zárate
Especialista en Gestión y Calidad

Página 3 de 4


José Cáceres Torres
Jefe, Dpto. Gestión y
Calidad

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

Toda la renovación del software solicitado se integrará a la plataforma informática con la que cuenta el Banco Central de Reserva del Perú.

- Soporte y mantenimiento externo
La renovación se realizará por un año, para cada grupo de licencias, debiendo incluir: Soporte técnico por el fabricante, Parches (Fixes), Services Packs y actualización de versiones.
- Tiempo en que se va a entregar la solución con las condiciones exigidas por el Banco Central de Reserva del Perú

El plazo de entrega será no mayor de 20 días calendario contados a partir de la suscripción de la orden de compra o contrato.

Beneficios:

- La actualización tecnológica que permita la continuidad de las labores que realiza ésta Institución.
- El aprovechamiento de la experiencia en el uso de las funcionalidades del software Eviews por parte de los usuarios del Banco.
- La Gerencias: Central de Estudios Económicos, Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera, Operaciones Internacionales, Gestión del Circulante, así como la Subgerencia de Sucursales, podrán seguir atendiendo sus procesos internos de trabajo en forma normal, utilizando dicho software. Con lo cual se optimiza el rendimiento del personal de dichas áreas.

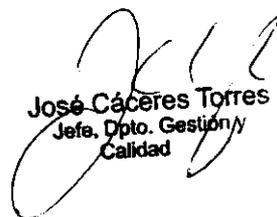
9. CONCLUSIONES:

Por los motivos antes señalados, se concluye que el Software Eviews cumple con todos los requerimientos técnicos, la renovación de su licenciamiento y soporte técnico posibilitarán a los usuarios del Banco contar con las últimas versiones del software Eviews oportunamente, asegurando el cumplimiento de las funciones propias del Banco Central de Reserva.

10. FIRMAS:



Julio Rivera Zárate
Especialista en Gestión y Calidad



José Cáceres Torres
Jefe. Dpto. Gestión y
Calidad

