

# BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

INFORME N° 0075-2025-GTI010-N

**ASUNTO:** INFORME TÉCNICO PREVIO DE EVALUACIÓN DE SOFTWARE -  
RENOVACIÓN DE LA CONTRATACIÓN DEL DERECHO DE USO DE  
LAS LICENCIAS DEL SOFTWARE ABACUS - CLEARWATER

**1. NOMBRE DEL ÁREA:**

Departamento de Estrategia Digital y Planeamiento

**2. RESPONSABLE DE LA EVALUACIÓN:**

José Cáceres Torres  
Oscar Alberto Taddey Chacaltana

**3. CARGOS:**

Jefe del Departamento de Estrategia Digital y Planeamiento  
Especialista en Estrategia Digital y Planeamiento

**4. FECHA:**

2025-02-28

**5. JUSTIFICACIÓN:**

**Gerencia de Operaciones Internacionales**  
**Departamento de Bases de Datos de Reservas Internacionales**

<b>1. Descripción</b> Renovación anual del software "Abacus" correspondiente al período mayo 2025 – abril 2026	El presente informe sustenta la necesidad de contratar a la empresa Clearwater Analytics (Ex-WILSHIRE ADVISORS LLC) la renovación del software "Abacus", el cual permite acceder a reportes analíticos de medición de desempeño como valorización de portafolios y cálculo de retornos, agregados y desagregados. La empresa Clearwater Analytics, fundada en 2004, su sede principal se encuentra en 777 W Main Street, Suite 900, Boise Idaho, Estados Unidos, cuenta con oficinas adicionales en Londres, Edimburgo, Nueva York y Noida. A través de su software "Abacus" permite de manera eficiente y flexible la medición del desempeño y riesgo que es utilizado para la gestión de los portafolios a cargo de la Gerencia de Operaciones Internacionales.
<b>2. Razones para realizar la renovación</b>	Dos funciones esenciales de la administración de las reservas internacionales se refieren a la medición del desempeño y la gestión de los riesgos del portafolio de inversiones. Considerando la necesidad de contar con un software que permita realizar de manera automatizada cálculos de rentabilidad y riesgo del portafolio de inversiones del Banco, se solicita la renovación de esta licencia.
<b>3. Frecuencia de Realización</b>	Las unidades organizacionales de la Gerencia de Operaciones Internacionales recurren a dicho software permanentemente, para contar con información diaria, semanal y mensual para el

## BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

	manejo táctico de las Inversiones (Front Office), manejo estratégico (cálculo de retornos) (Middle Office) y de control de los valores en custodia (Back Office).
<b>4. Beneficio esperado</b>	En la actualidad el software “Abacus”, brinda información detallada de la medición del desempeño de los portafolios de manera automatizada, la que viene siendo utilizada para los informes de gestión de reservas que se elaboran en la Gerencia. Asimismo, se cuenta con herramientas de medición de riesgos y de flujos de fondos, útiles para las unidades organizacionales de la Gerencia. Adicionalmente, el software “Abacus” es uno de los principales sistemas que provee de información al “Sistema de Información Gerencial - GOI”.
<b>5. Uso de licencias</b>	Cabe destacar que para Abacus se mantiene el número de licencias concurrentes en 10 y no concurrentes en 12.
<b>6. Otros comentarios</b>	Clearwater Analytics es una empresa estadounidense que ofrece soluciones de software para el servicio de medición del desempeño, gestión contable y control de inversiones. Clearwater Analytics se especializa en la agregación, reconciliación y elaboración de informes de datos de inversión, proporcionando informes precisos y personalizados a más de 1,000 organizaciones en todo el mundo.

### 6. ALTERNATIVAS:

Actualmente, se cuenta con la siguiente relación de licencias del software Abacus - Clearwater:

- Diez (10) licencias concurrentes del software Abacus.
- Doce (12) licencias no concurrentes del software Abacus.

Dicho software se encuentra instalado en la plataforma informática del Banco con servicio de mantenimiento y soporte técnico. Asimismo, se viene usando en el Banco desde el 2007.

En consecuencia, lo solicitado en este proceso es sólo la renovación de la contratación del derecho de uso de las licencias del software Abacus - Clearwater, con el servicio de mantenimiento y soporte técnico, por lo que no se presentan otras alternativas. El software Abacus no admite sustitutos considerando que los reportes elaborados por la empresa están basados en su modelo propietario de atribución de desempeño Global Credit Risk. En particular, la información que brinda Clearwater es única y no existe un proveedor local que brinde algo similar.

### 7. ANÁLISIS COMPARATIVO TÉCNICO:

Como no se presentan otras alternativas, no cabe un análisis comparativo técnico. En ese sentido, se efectuará durante el proceso una evaluación de los servicios adicionales.

### 8. ANÁLISIS COMPARATIVO DE COSTO – BENEFICIO:

#### Costos:

Costos asociados al producto incluyen:

- Renovación de Licencias

## BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

Renovación de la contratación del derecho de uso de las licencias del software Abacus - Clearwater con el servicio de mantenimiento y soporte técnico, para el periodo del 01-05-2025 al 30-04-2026, las cuales son:

- ✓ Diez (10) licencias concurrentes del software Abacus.
- ✓ Doce (12) licencias no concurrentes del software Abacus.

El precio referencial es de USD 231 473,28 sin impuestos.

➤ Hardware necesario para su funcionamiento

La renovación del derecho de uso de las licencias del software Abacus - Clearwater con el servicio de mantenimiento y soporte técnico, se integrará a la plataforma informática con la que cuenta el Banco Central de Reserva del Perú.

➤ Soporte y mantenimiento externo

La renovación incluye: soporte técnico por el fabricante, parches (fixes), service packs y actualización de versiones.

➤ Periodo en que se va a prestar la solución con las condiciones exigidas por el Banco Central de Reserva del Perú

El periodo de prestación de la solución es desde el 01-05-2025 al 30-04-2026.

Beneficios:

- La actualización tecnológica que permita la continuidad de las labores que realiza esta institución.
- El software Abacus – Clearwater permite la automatización del ciclo de vida de la inversión. Automatiza procesos clave, desde la planificación de la cartera hasta la generación de informes de rendimiento y la gestión de riesgos.
- El software Abacus – Clearwater permite el acceso en tiempo real a datos precisos, facilitando la toma de decisiones informadas y oportunas.
- El software Abacus – Clearwater permite mejorar en la eficiencia operativa, al automatizar tareas repetitivas y proporcionar análisis detallados.

### 9. CONCLUSIONES:

Por los motivos antes señalados, se concluye que el software Abacus - Clearwater cumple con todos los requerimientos técnicos, la renovación de la contratación del derecho de uso de las licencias del software Abacus - Clearwater con el servicio de mantenimiento y soporte técnico, posibilitará a los usuarios contar con las últimas versiones del software y el soporte técnico en forma oportuna, asegurando el cumplimiento de las funciones propias del Banco Central de Reserva del Perú. Por lo cual se recomienda la contratación del derecho de uso de las licencias del software Abacus - Clearwater con el servicio de mantenimiento y soporte técnico.

### 10. FIRMAS:

**Departamento de Estrategia Digital y Planeamiento**

**Lima, 28 de febrero de 2025**

# BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

FIRMADO POR:

Oscar Alberto TADDEY CHACALTANA  
Especialista en Estrategia Digital y Planeamiento  
Departamento de Estrategia Digital y Planeamiento

Jose Carlos CACERES TORRES  
Jefe de Departamento de Estrategia Digital y  
Planeamiento  
Departamento de Estrategia Digital y Planeamiento

Silvia Elizabeth MEDINA MORENO  
Gerente de Tecnologías de Información  
Gerencia de Tecnologías de Información

VISADO POR:

Javier Ernesto OLIVERA VEGA  
Gerente Central de Administración  
Gerencia Central de Administración