

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

MEMORANDO N° 0043-2014-ADM100-N

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

DE : Javier Ricardo Gutiérrez González
Subgerente de Logística

ASUNTO : Estandarización del Software Eviews

FECHA : 31 de enero de 2014

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 No. 0004-2014-GTI240, elaborado por el Departamento de Gestión y Calidad referido a la estandarización para la renovación del mantenimiento y soporte técnico del software Eviews.

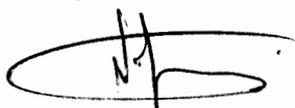
De acuerdo con lo indicado en el informe del Departamento de Gestión y Calidad, se cuenta con 95 licencias del software Eviews, las que están instaladas en la plataforma informática del Banco y son utilizadas para el desarrollo de modelos econométricos, análisis estadísticos, proyección de variables económicas y financieras.

Se señala asimismo que se requiere renovar el servicio de mantenimiento y soporte de las licencias indicadas, con el fin de garantizar que las nuevas versiones del software estén disponibles y puedan ser instaladas a los usuarios y que el soporte técnico provee asistencia técnica en caso se presenten problemas en el uso del software.

Considerando que el Banco es propietario de las licencias Eviews, es decir, que se trata de bienes preexistentes, que el servicio de mantenimiento es de carácter complementario, dado que permitirá contar con las últimas versiones del software así como con el soporte técnico necesario para su adecuado funcionamiento, y que el servicio a contratar es indispensable para asegurar la vigencia tecnológica del software, se concluye que la solicitud planteada por el Departamento de Gestión y Calidad 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 renovación del servicio de mantenimiento y soporte de las licencias del software Eviews que posee el Banco.

Atentamente,



1318 / 1877

002516



* MEMORANDO 0043-2014-ADM100 *

Banco Central de Reserva del Perú Gerencia Central de Administración
26 FEB. 2014
RECIBIDO
Hora:..... N° Reg.:.....

Página 1 de 1

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

MEMORANDO N° 0017-2014-GTI200

A : Señor Javier Ricardo Gutiérrez González
Subgerente de Logística

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

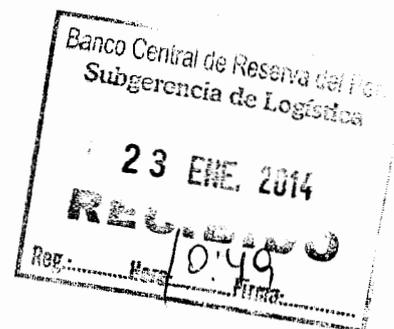
ASUNTO : Estandarización del Software Eviews

FECHA : 22 de enero de 2014

Por medio del presente, sírvase encontrar adjunto el informe No. 0004-2014-GTI240 elaborado por el señor Julio Rivera sobre la estandarización del Software Eviews, para los fines pertinentes.

Atentamente,


MIGUEL TEJADA MALASPINA
Subgerente de Servicios de
Tecnologías de Información



BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

INFORME N° 0004-2014-GTI240

PARA: Señor Miguel Tejada
Subgerente de Servicios TI

Felipe Rosales Montellari
Gerente de Tecnologías de Información

MIGUEL TEJADA MALASPINA
Subgerente de Servicios de
Tecnologías de Información

ASUNTO: Estandarización 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

5. DESCRIPCIÓN DEL EQUIPAMIENTO O INFRAESTRUCTURA PREEXISTENTE:

Se cuenta con 95 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 bien o servicio requerido es 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 é 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.

2097 / 1152

001505



* INFORME 0004-2014-GTI240 *

Julio Rivera Zárate
Especialista en Gestión y Calidad

Página 1 de 4

José Cáceres Torres
Jefe. Dpto. Gestión y
Calidad

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

- 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.
- 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.

2097 / 1152

001505



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

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. 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.

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 95 licencias del software Eviews, las mismas que se encuentran instaladas en la plataforma informática del Banco.

2097 / 1152

001505



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

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.

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 impulso respuesta. En tal sentido, los usuarios manifiestan que es una herramienta de carácter imprescindible.

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, por 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
Especialista en Gestión y Calidad


José Cáceres Torres
Jefe, Dpto. Gestión y
Calidad

Departamento de Gestión y Calidad

22 de enero de 2014

2097 / 1152

001505



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

Página 4 de 4