

INFORME TÉCNICO PREVIO DE EVALUACIÓN DE SOFTWARE

“SISTEMAS DE CAMBIOS, INVERSIONES Y TESORERÍA”

1. NOMBRE DEL ÁREA:
Departamento de Informática
Departamento de Operaciones
2. RESPONSABLE DE LA EVALUACIÓN:
Marco Mena Miranda
José Santillana Castillo
3. CARGO:
Supervisor – Departamento de Informática
Supervisor – Departamento de Operaciones
4. JUSTIFICACIÓN
La adquisición del aplicativo permitirá la eliminación de procesos manuales mediante la simplificación y automatización de las operaciones de Cambios, Inversiones y Tesorería.

- 4.1. Para las operaciones de cambio de monedas permitirá:

- A las diferentes áreas usuarias de la Oficina Principal el registro en línea de las operaciones de la compra venta de divisas en el mercado local y en el mercado externo.
- Mediante interfases con el Host consolidar con las operaciones realizadas en la Red de Agencias, ATM's e Internet.
- Realizar operaciones Forward, Swap, Opciones, Futuros, otros.
- Generar automáticamente los reportes para la SBS, BCRP y reportes internos.
- Registrar en línea la compra venta de divisas realizadas en las plataformas de negociación.
- Controlar los límites operativos, stoploss, nivel de exposición global y por monedas en línea.
- Liquidar automáticamente los pagos vía LBTR con Bancos y con Clientes Institucionales.
- Generar automáticamente mensajes Swift de confirmación y pago recibidos y enviados con Bancos del exterior.
- Interconexión con Sistema LBTR del BCRP.

4.2. Para las operaciones de Inversiones permitirá:

- Registrar en línea la compra venta de instrumentos de renta fija y variable en el mercado local y en el exterior,
- Generar automáticamente los reportes de Posición, Ingresos y Rentabilidad.
- Controlar los límites operativos, por composición de portafolio, montos subastados y según clasificación en línea.
- Liquidar automáticamente los pagos vía LBTR con las cuentas de contraparte y de Banco Custodio.
- Controlar las compras/ventas, vencimientos, pagos cupón, dividendos, otros.
- Calcular el costo amortizado, valor razonable, intereses, fluctuación con aplicación de la TIR no periódico en base a metodología de la SBS.
- Generar automáticamente los anexos para la SBS, Anexos de Balance, otros.
- Registrar automáticamente en Cavali las compras ventas de valores.



- Interconexión con Sistema de Cavali y con el LBTR del BCRP.

4.3. Para las operaciones de Tesorería permitirá:

- Llevar un control del movimiento de nuestras cuentas en Bancos locales y en Bancos del Exterior.
- Generar en forma automática los mensajes Swift para depósitos overnight, a plazo y transferencias entre el BCRP y Bancos del exterior y viceversa, canjes con Bancos.
- Llevar un control de las operaciones realizadas, generar las alertas por los depósitos según la categoría.
- Generar automáticamente reportes.
- Interconexión con Sistema LBTR del BCRP.

Para todos los casos permitirá la contabilización automática y la generación de estadísticas.

5. ALTERNATIVAS

Se ha considerado el siguiente software:

- ✓ Back Trader
- ✓ Spectrum

6. ANÁLISIS COMPARATIVO TÉCNICO:

FINANCIAL SOFTWARE SYSTEMS	SONDA DEL PERU S.A.
Spectrum	Bac Trader
Funcionalidad integral, cobertura de instrumentos y tecnología de vanguardia.	Controla, administra y gestiona las operaciones realizadas por la Mesa de Dinero.
Sistema global e integrado para la tesorería que funciona con productos múltiples en tiempo real, permitiendo consolidar instantáneamente varios centros de transacciones	La solución está compuesta por varios módulos, las pantallas tienen estándares diferentes de un módulo a otro.
Duración de implementación: menor a 150 días	Duración de implementación: 150 días
Tiempo de garantía: 01 año	Tiempo de garantía: 01 año
Mantenimiento preventivo: 06 veces al año	Mantenimiento preventivo: 06 veces al año
Esquema de soporte in situ o asistencia remota con disponibilidad las 24 horas de lunes a viernes	Esquema de soporte in situ o asistencia remota con disponibilidad las 24 horas de lunes a viernes
Soporte de lunes a viernes de 8:00 a.m. a 8:00 p.m.	Soporte de lunes a viernes de 8:00 a.m. a 8:00 p.m.
Lenguaje de Programación: Java o .Net	Lenguaje de Programación: .Net
Base de datos: SQL	Base de datos: SQL
Esquema de trabajo: cliente - servidor	Esquema de trabajo: cliente - servidor
Sistema Operativo: Windows 2003 Server	Sistema Operativo: Windows 2003 Server
Interconexión con Sistema de Cavali, LBTR del BCRP, con plataformas de negociación e información y con Sistemas propios de Bancos del exterior.	Interconexión con Sistema de Cavali, LBTR del BCRP, con plataformas de negociación e información y con Sistemas propios de Bancos del exterior.



7. ANALISIS COMPARATIVO DE COSTO – BENEFICIO

LICENCIAMIENTO

Esquema de licenciamiento integral que garantiza la disponibilidad de licencias necesarias para los ambientes de desarrollo, certificación y producción (incluido el ambiente de contingencia) en los cuales se implemente la aplicación.

Licenciamiento para un mínimo de 120 estaciones cliente y con una oferta ilimitada.

HARDWARE NECESARIO PARA SU FUNCIONAMIENTO

- Los que utilizan actualmente los aplicativos del Banco.

SOPORTE Y MANTENIMIENTO EXTERNO

En cuanto al soporte técnico este debe ser dado in-situ en nuestra sede administrativa de Javier Prado – Orrantía.

El tiempo máximo de respuesta a fallas debe ser de 2 horas y será atendido por un técnico durante las 24 horas de Lunes a Viernes (24 X 5).

Este soporte estará vigente durante el tiempo que dure la garantía.

PERSONAL Y MANTENIMIENTO INTERNO

El personal del Banco recibirá la capacitación necesaria para mantener una alta disponibilidad de utilización del software.

CAPACITACIÓN

Capacitación con respecto a la funcionalidad y operación del aplicativo

- Técnico: para personal de Soporte, Producción y Desarrollo de Aplicaciones. Mínimo diez (10) personas, cuarenta (40) horas por persona.
- Administrador de la aplicación. Mínimo cinco (5) personas, cuarenta (40) horas por persona.
- Módulo de Accesos: Mínimo 5 personas, 10 horas por persona.

La capacitación se dará en las instalaciones del Banco y en forma presencial.

TIEMPO DE ENTREGA DEL APLICATIVO (TIME TO MARKET)

El plazo de entrega se medirá en días calendario, para efectos de evaluación.

El máximo tiempo de entrega será de 150 días, contados a partir de la firma del contrato de aceptación.

GARANTIA

Garantía mínima de 12 meses y computado a partir de la firma del Acta de Aceptación.

La garantía cubre la actualización de versiones de la aplicación, así como la modificación de programas debido a fallas y/o vicios ocultos



BENEFICIOS

- Incremento del número de operaciones que se realizan en operaciones de compra venta de monedas y en instrumentos o valores.
- Generación de negocios en operaciones de Renta Variable.
- Generación de negocios en operaciones Forward, Swap, Opciones, Futuros, otros.
- Contabilización automática.
- Generación automática vía cálculos de costo amortizado, valor razonable, intereses, fluctuación con aplicación de la TIR no periódico en base a metodología de la SBS.
- Generación automática de anexos de balance.
- Generación automática de anexos y reportes para la SBS y para el BCRP
- Generación automática de reportes internos de cambios, inversiones y tesorería
- Generación automática de mensajes Swift.
- Conexión en línea con el computador central
- Control en línea de límites por las operaciones de divisas y de valores y otros.
- Eliminación de procesos manuales.
- Reducción de costos y horas hombre.
- Disminución de errores y riesgos operativos.
- Simplificación de los procesos operativos.
- Organización interna en cuanto al control de las operaciones y al control de actividades (labores) del personal del área.
- Información en línea y menor uso de papel.
- Interconexión mediante interfases con plataformas de negociación e información.
- Maximización de ganancias y minimización de pérdidas mediante el uso de simuladores.

8. CONCLUSIONES

- Automatización de los procesos operativos y contables, relacionados con las operaciones de Cambios, Inversiones y Tesorería.
- Eliminación de procesos manuales y disminución de errores operativos.
- Generación automática de reportes internos y externos.
- Información oportuna para la toma de decisiones, lo que ayudará a maximizar nuestras inversiones generando mayor rentabilidad.
- Variedad de instrumentos para realizar operaciones.
- Mayores posibilidades de negocios.
- Interfases con sistemas de negociación, información, liquidación y custodia.
- Consolidación en línea de operaciones realizadas en nuestros canales de atención
- Utilización de simuladores.
- Controlar en línea los límites operativos establecidos en los reglamentos internos
- Inversión recuperable en el corto plazo por mayor variedad de negocios, mayor rentabilización de inversiones y reducción de costos operativos.

9. FIRMA:

Responsables de la Evaluación	
Marco Mena Miranda	
José Santillana Castillo	

