

17 de Mayo de 2010

Pliego de prescripciones técnicas aplicable a la contratación de los servicios de acceso a una herramienta de mercado para la valoración de activos financieros complejos.

ÍNDICE

1. REQUERIMIENTOS TÉCNICOS.....	1
2. DESCRIPCIÓN DE LA SITUACIÓN ACTUAL.....	1
3. DESCRIPCIÓN Y REQUISITOS DEL PROYECTO	1
4. OFERTA	4

1. REQUERIMIENTOS TÉCNICOS

El objeto del presente procedimiento es la contratación de los servicios de acceso a una herramienta que permita, al Banco de España en el ejercicio de sus funciones, conocer el valor de las carteras de las actividades de Tesorería de las entidades supervisadas y de los modelos de riesgo de mercado presentados por éstas para su validación a efectos de uso regulatorio del Pilar 1 de Basilea II.

2. DESCRIPCIÓN DE LA SITUACIÓN ACTUAL

La Dirección General de Supervisión (DGS) dispone en la actualidad de herramientas de soporte para sus actuaciones inspectoras en el área de Tesorería. De forma complementaria, se considera conveniente poder utilizar una herramienta suficientemente implantada y contrastada en el mercado que permita una adecuada comparación de los resultados derivados de la aplicación de las metodologías de cálculo de las propias Entidades y del Banco de España.

3. DESCRIPCIÓN Y REQUISITOS DEL PROYECTO

Entorno tecnológico

La herramienta se operará en modo ASP (Application Service Provider). En base a este modelo, la empresa adjudicataria ofrecerá de forma remota su aplicación con arreglo a un acuerdo de nivel de servicio previamente establecido, garantizando la integridad, seguridad y confidencialidad de la información administrada.

Los sistemas de interconexión utilizados deberán preservar la seguridad de las infraestructuras del Banco de España.

Descripción de los trabajos

Los trabajos a realizar incluyen la implementación en modo ASP de la herramienta que se seleccione y el cumplimiento del acuerdo de nivel de servicio que se establezca, todo ello conforme con los requerimientos de negocio y con los requisitos de seguridad indicados a continuación. Los trabajos de implementación incluirán la parametrización de los productos a valorar.

Las ofertas deberán considerar la posibilidad de que sea necesario verificar una prueba de concepto que demuestre la viabilidad técnica real de cumplir con los requisitos funcionales y técnicos establecidos.

La herramienta que se seleccione deberá cubrir los siguientes requerimientos de negocio:

- Valoración de carteras de tesorería compuestas por productos “plain vanilla”, productos derivados OTC básicos y “exóticos”, y productos estructurados. Amplia cobertura de instrumentos financieros

e incorporación eficiente de nuevos productos y subyacentes, con compromiso del proveedor de actualización a las innovaciones del mercado.

- Estimación del riesgo de mercado (VaR) mediante distintas metodologías: paramétricas, simulación histórica y simulación Monte Carlo.
- Facilidad en la incorporación de precios y factores de mercado desde distintos distribuidores de información financiera y posibilidad de operar con curvas cupón cero ya generadas. BackOffice por parte del proveedor para obtención, análisis y aseguramiento de calidad de los datos de mercado que sirvan de datos de contexto a la operación de la aplicación.
- Flexibilidad en la incorporación de los inputs de posiciones y productos contratados, así como de datos de contexto para su valoración. Estos últimos deberán ser de dos tipos: los que sean aplicables con carácter general y los que sean aplicables, en particular, para una actuación inspectora concreta.
- Producto de amplia implantación en entidades financieras cuya supervisión tenga legalmente atribuida el Banco de España, o equivalentes a juicio de la Dirección General de Supervisión. Sus algoritmos de valoración y estimación de riesgos deberán estar suficientemente documentados, permitiendo su conocimiento por el Banco.
- Las funciones deben ser accesibles desde la red interna del Banco y, conectados en remoto, desde los ordenadores portátiles de los equipos de inspección desplazados en inspecciones in-situ.

El acuerdo de nivel de servicio que se establezca deberá considerar, al menos, los siguientes puntos:

- Preservación en todo momento de la confidencialidad e integridad de los datos, así como el control estricto de su acceso sólo por parte de personas autorizadas a tal fin, y siempre que sea posible auditoría de dichos accesos.
- Capacidad de proceso para albergar, al menos, tres acciones supervisoras simultáneamente.
- Ventana máxima para la obtención del proceso de valoración de una entidad completa de 5 días hábiles.
- Soporte funcional y técnico, al menos, de lunes a viernes en horario de oficina en España, previendo que los procesos puedan quedarse operando en el sistema los fines de semana o, al menos, que los procesos puedan quedarse operando durante el tiempo necesario para poder realizar la valoración completa.
- Cortes en el servicio por incidencias no planificadas: ventana de 5 días hábiles, siempre que la incidencia no sea reiterativa.
- Cortes en el servicio por incidencias planificadas: deberán ser siempre pactados con el Banco de España para establecer las fechas en las que la aplicación podrá encontrarse no disponible.

- El sistema deberá disponer de procesos de backups de información de dos tipos: recuperación ante desastres y de finalización y descarga de inspección. Los backups para recuperación ante desastres deberán realizarse de forma regular, recogiendo todo el estado de la aplicación y de todos sus datos al día de la fecha con el objeto de poder poner de nuevo en funcionamiento la herramienta, para las acciones supervisoras que estén en marcha, ante un eventual incidente o desastre.
- El proveedor deberá mantener los mecanismos que posibiliten a la Dirección General de Supervisión tener disponible el resultado del proceso de valoración de una entidad procesada.

Lugar de realización de los trabajos

Los trabajos de implementación y parametrización podrán realizarse en las dependencias del Banco de España o en las que éste autorice y determine. La prestación del servicio se realizará desde las instalaciones del proveedor.

Planificación, dirección y seguimiento de los trabajos

El Banco de España designará un Jefe de Proyecto cuyas funciones en relación con el objeto del presente pliego serán las siguientes:

- Velar por el cumplimiento de los trabajos exigidos y ofertados.
- Emitir las certificaciones parciales de recepción de los mismos.

El Jefe de Proyecto podrá delegar sus funciones en una persona de su equipo. Asimismo, podrá incorporar al proyecto durante su realización, las personas que estime necesarias para verificar y evaluar todas las actuaciones a su cargo.

El seguimiento y control del proyecto se efectuará sobre las siguientes bases:

- Seguimiento continuo de la evolución del proyecto entre el responsable del equipo de trabajo por parte del adjudicatario y el Jefe de Proyecto del Banco de España.
- Reuniones de seguimiento y revisiones técnicas, con periodicidad mensual, del responsable del equipo de trabajo por parte del adjudicatario, y del Jefe de Proyecto del Banco de España o persona en quien delegue, al objeto de revisar el grado de cumplimiento de los objetivos, las reasignaciones y variaciones de efectivos de personal dedicado al proyecto, las especificaciones funcionales de cada uno de los objetivos y la validación de las programaciones de actividades realizadas.
- Tras las revisiones técnicas, de las que se levantará acta, el Jefe de Proyecto del Banco de España podrá rechazar en todo o en parte los trabajos realizados, en la medida que no respondan a lo especificado en las reuniones de planificación o no superasen los controles de calidad acordados.

4. OFERTA

Con independencia de que el licitador pueda adjuntar a su Oferta cuanta información complementaria considere de interés, deberá incluir obligatoriamente la siguiente:

- Planificación incluyendo los trabajos previstos para adaptar la herramienta a los requisitos del Banco de España (carga de datos, informes, parametrización, etc.), así como para su operación desde los puestos de Supervisión.
- Información relativa a los requerimientos técnicos de conexión de la herramienta y de los aspectos de seguridad que tendrá en cuenta a fin de garantizar la confidencialidad, integridad, disponibilidad, autenticación, control de accesos y auditabilidad, en su caso, de la información remitida por el Banco de España.

Se valorará la preparación de una estrategia de formación en la herramienta, así como que dicha formación y la documentación de trabajo se encuentre disponible en idioma español.