

# BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

INFORME N° 0257-2023-GTI220-N

## *Términos de referencia*

### ***Servicio de soporte y mantenimiento del software Trade Thru para los años 2024 y 2025***

#### **REQUERIMIENTOS TÉCNICOS MÍNIMOS:**

##### **1. DESCRIPCIÓN**

Contratar para los años 2024 y 2025, el derecho de actualización y soporte técnico del software Trade Thru con la empresa SS&C Technologies Inc., domiciliada en los Estados Unidos de Norteamérica, por ser proveedor único.

##### **2. MANTENIMIENTO Y SOPORTE TÉCNICO**

A igual que la última contratación realizada, se resume a continuación los requerimientos del BCRP para el período de contratación:

- Actualización de los programas del software Trade Thru
- Soporte telefónico y del tipo remoto para el soporte de defectos de funcionamiento del producto Trade Thru de 9 am a 5 pm de lunes a viernes, excepto los feriados que pueda haber en Perú y en Estados Unidos de Norteamérica.

Según el contrato vigente, este requerimiento es denominado, por el proveedor “Basic Support Services”.

Se precisa que el íntegro de la prestación se ejecutará desde los Estados Unidos de Norteamérica, 80 Lamberton Road, Windsor, CT 06095, vía medios electrónicos.

##### **3. CARACTERÍSTICAS TÉCNICAS DEL SOFTWARE DEL BCRP**

El software es una solución integral automatizada para la administración de instrumentos del mercado financiero internacional orientada a las tareas que realiza la Gerencia de Operaciones Internacionales (GOI), sus principales funciones son:

- Se tiene acceso a una gama actualizada de instrumentos del mercado.
- Se cuenta con un sistema relativamente flexible que permite al usuario interactuar con pantallas tipo Windows, simplificándose el ingreso de datos y facilitando un control de las operaciones más eficiente.
- Proporciona una mayor rapidez en el flujo de información entre el Front, Middle y Back Office referente a operaciones realizadas.
- Ofrece un mecanismo de control de riesgos más efectivo, para el establecimiento de límites con las contrapartes.
- Se cuenta con un software que permite adecuar la información para el envío de los mensajes SWIFT en el formato apropiado como parte de la conexión automática a dicho sistema de mensajería.
- Se dispone de una base de datos en Oracle compatible con el software que viene utilizando el Banco.

## BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

- El acceso a la base de datos permite el diseño de reportes y la integración al sistema para medición del desempeño de las inversiones de la empresa de servicios informáticos Wilshire, a través de sus productos “Abacus”.
- Se cuenta con una macro (mejora aplicada desde el segundo trimestre de 2013) que permite dividir automáticamente operaciones de bonos superiores a un valor nominal determinado, “split swift messages MT54X”, para después ser transferidos a la bandeja del Swift. La Reserva Federal de los Estados Unidos, tiene por regla no procesar transacciones que se liquiden en el mercado doméstico norteamericano, que superen los USD 50 millones en valor nominal. Igualmente se aplica esta restricción en el mercado doméstico canadiense.
- Se realizó una modificación al reporteador “Trade Blotter” (mejora aplicada desde el segundo trimestre de 2013), que permite seleccionar funciones múltiples, aplicables a los siguientes campos específicos: Profit center, Product type, Broker, Currency 1 y Currency 2, User, Trade Class y Dealer.
- Selección automática de límites disponibles para valores. Muestra los límites disponibles relevantes para la operación a realizar, ya sea por tipo de instrumento, emisor y emisión.
- Se mejoró el sistema de alerta de los mensajes (warnings) para la función Quantity Allocation Macro, así como la ventana de búsqueda de contrapartes con campos adicionales. Del mismo modo, se mejoró el menú modular Workload Count.
- Se implementó la interface para recibir las operaciones que se generan en Bloomberg y se capturan en el Front Office Deal Capture Screen de Trade Thru.
- Se implementó una mejora que permite realizar ventas parciales específicas, sin la necesidad de aplicar la función FIFO.
- Se ha desarrollado un *Webservice Call to TT to Create CSH Trades*, que permitirá a través de un Webservice, que todas las operaciones de la Banca Local sean transferidas electrónicamente de la plataforma del LBTR al TT, eliminando de este modo el uso de hojas Excel y el ingreso manual de dichas operaciones al TT1.

Cabe resaltar que la Gerencia de Operaciones Internacionales como usuaria del TT, realiza consultas directas al proveedor, SS&C, sobre funcionalidades operativas y mejoras que brinda el sistema para el registro, proceso y control de las operaciones por la administración de reservas.

#### 4. DOCUMENTOS DE PRESENTACIÓN OBLIGATORIA

Carta del proveedor o Invoice dirigida al Banco Central de Reserva del Perú en la que se indique que están otorgando el servicio de soporte a la licencia Master del Software Integral y Solución para los Servicios de Soporte de Inversiones Internacionales del BCRP.

#### 5. PLAZO DEL SERVICIO

Desde el 01-01-2024 hasta el 31-12-2025

#### 6. LUGAR DE ENTREGA

El documento especificado en el numeral 4 será entregado por correo o por la mesa de partes virtual: [mesadepartessvirtual@bcrp.gob.pe](mailto:mesadepartessvirtual@bcrp.gob.pe).

# **BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ**

## **7. FORMA DE PAGO**

Los costos se pagan por adelantado en forma semestral, durante los dos años que dura el servicio.

## **8. CONFORMIDAD**

La conformidad del servicio para el pago será realizada por el Departamento de operaciones, plataforma y base de datos.

**Lima, 24 de octubre de 2023**

**cc.**

# **BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ**

FIRMADO POR:

VISADO POR: