

TÉRMINOS DE REFERENCIA PARA LA CONTRATACIÓN DE SERVICIOS

| | |
|--|--|
| Unidad orgánica usuaria | Gerencia de Inversiones |
| Actividad del POI | 1.2. Para la cartera Decreto Legislativo N°1133, alcanzar un rendimiento prospectivo estimado no menor a la tasa de interés técnico establecida más el indicador de gastos de administración de la cartera. Actividad: Ejecución de inversión del Régimen de Pensiones del Decreto Legislativo N°1133 |
| Denominación de la contratación | Contratación del SERVICIO DE CONSULTA EN LÍNEA DE DATOS Y ANÁLISIS DE INFORMACIÓN FINANCIERA PARA LA CPMP (24 meses). |

| I. FINALIDAD PÚBLICA (Obligatorio) | | |
|--|--|--|
| La presente contratación permitirá a La Caja de Pensiones Militar Policial obtener información financiera y económica internacional y contar con una solución de negociación de modo que ayude a una adecuada toma de decisiones en la gestión financiera. | | |
| II. OBJETIVO DE LA CONTRATACIÓN (Obligatorio) | | |
| Contar con una solución capaz de trabajar de manera continua y que permita monitorear las diversas oportunidades de inversión a fin de crear valor en los portafolios de instrumentos financieros. | | |
| III. ALCANCES DEL SERVICIO (Obligatorio) | | |
| 3.1 Cantidad del Servicio a contratar: | | |
| | | |
| N° | CANTIDAD | DESCRIPCION |
| 1 | 1 | Suscripción trimestral (multiusuario/acceso compartido) para un terminal (PC) para el SERVICIO DE CONSULTA EN LÍNEA DE DATOS Y ANÁLISIS DE INFORMACIÓN FINANCIERA. |
| 2 | 1 | Una Pantalla doble de 23" con su parante de base propio. |
| 3 | 1 | Un CPU. |
| 4 | 1 | Un Teclado Bloomberg |
| 5 | 1 | Un Mouse |
| 3.2 Descripción del Servicio a contratar: | | |
| Abarca desde la etapa de a) análisis, orientada al proceso de toma de decisiones de inversión, b) la negociación, en lo que respecta a la ejecución y recepción de órdenes, hasta c) el control y seguimiento de posiciones y riesgos. | | |
| a) Análisis: | | |
| i. | Información de mercado: permite el acceso a diversas fuentes de precios para los diferentes activos listados en el sistema, tales como instrumentos representativos de deuda, instrumentos de renta variable, divisas, commodities, tasas de interés, entre otras. Así mismo, permite el acceso a diversas curvas de rendimiento de los mercados internacionales y locales. | |
| ii. | Herramientas de análisis y valoración: proporciona información descriptiva, recomendaciones de los principales analistas del mercado, cálculos de rendimiento y riesgo, modelos de valoración de instrumentos de renta variable y fija, análisis técnico, administración de portafolios; permite también bajar la información de precios y series históricas al programa Microsoft Excel, a través de la interfaz de aplicaciones de programación. Esto siempre y cuando los datos sean utilizados solo en la PC donde está instalada la licencia Bloomberg. | |
| iii. | Noticias: Provee acceso a información del mundo financiero con una antigüedad desde 1992 en la medida que sea posible; cuenta con 15 redes informativas y ofrece | |

la posibilidad de intercambiar estudios completos sobre los mercados financieros, entre otras facilidades.

b) Negociación:

Permite el envío electrónico de órdenes, acceso a páginas de los clientes para cotizar a otros usuarios, confirmación de órdenes, cálculos de rendimiento, valor por cumplir, riesgo, convexidad, duración, entre otras herramientas. Acceso al sistema electrónico de negociación, trading de operaciones de cambio spot, operaciones de cambio forwards, depósitos bancarios, entre otros. La utilización del sistema de negociación puede tener costo adicional y el acceso puede habilitarse o inhabilitarse en cualquier momento.

c) Control y seguimiento:

Ofrece la posibilidad de manejar carteras específicas de activos, valorizarlos sobre base de los precios, control de órdenes, operaciones y seguimiento; hallar la exposición de los activos al riesgo de cambio en los mercados; analizar escenarios para las carteras creadas, permitiendo así anticipar movimientos futuros en el mercado. Asimismo, permite el manejo de diversas herramientas de control tales como la duración del portafolio, análisis de benchmark, herramientas de swaps de tasas de interés y de monedas, operaciones forward y futuros, entre otras; siempre y cuando toda la información y datos se utilicen solo en la PC donde está instalada la licencia Bloomberg.

IV. REQUISITOS MÍNIMOS DEL PROVEEDOR (Obligatorio)

El proveedor del servicio deberá contar con los siguientes requisitos:

- **DATOS:** Información sobre valores, datos derivados, anuncios de hechos relevantes, datos financieros de empresas, precios diarios/históricos y proyecciones.
- **NOTICIAS:** publicación diaria de noticias locales e internacionales e indicadores macroeconómicos.
- **ESTUDIOS:** Cubre el ciclo completo de un estudio, desde la generación y la confirmación de la idea hasta la publicación, colaboración, resultados y cumplimiento de normativas.
- **ANÁLISIS DE CARTERAS Y RIESGOS:** Rendimiento, atribución de rentabilidades, caracterización y riesgo de las carteras, valorización del portafolio, análisis de riesgo de mercado (VaR).
- **PLANTILLAS PERSONALIZADAS DINÁMICAS:** Exportación a Excel o Power Point.
- **LIQUIDEZ:** Acceso a fuentes de emisión de precios y mercados.
- **MENSAJERÍA:** Chat de consulta con el proveedor de información respecto a configuraciones, métricas, entre otros.
- **SERVICIOS ADICIONALES (VIRTUALES):**
 - a. Acceso a seminarios de formación gratuita.
 - b. Programa de formación en línea.
 - c. Conferencias.
 - d. Revistas virtuales / digitalizadas.
 - e. Boletines en línea.
 - f. Soporte 24x7 en línea, multilingüe (ilimitada).

VENTAJAS DEL SERVICIO:

- Red de información financiera interactiva en el mundo, que integra perfectamente lo mejor en datos, estudios, noticias y análisis de distintos mercados financieros.
- El Servicio de solución financiera cuenta con un *Help Desk* 24 horas al día, el cual constituye un servicio que responde a las inquietudes sobre el producto y su funcionalidad, en el idioma del usuario; dispone también de manuales en línea interactivos para todos los mercados.
- El Servicio de una solución financiera cuenta con un medio de comunicación que permite hacer uso del Chat en línea, a través del cual se interactúa con todos los usuarios del sistema en todo el ámbito mundial; bajo dicho entorno también permite enviar y recibir correos desde Internet.
- Permite a emisores promocionar electrónicamente las emisiones de instrumentos financieros representativos de capital y/o deuda ante inversionistas seleccionados.
- Adicionalmente, el servicio de solución financiera cuenta con una aplicación que permite

mantener abierta múltiples ventanas de información estandarizadas, así como crear páginas personalizadas con cuadros, noticias, gráficos y análisis de preferencia. De esta manera se puede acceder de manera fácil y precisa a la información que se necesita.

- El Servicio de una solución financiera ofrece a todos los usuarios entrenamiento permanente sin costo alguno, por medio de visitas personales y entrenamientos virtuales. Periódicamente organiza seminarios de entrenamiento en donde se trabaja sobre las herramientas que utilizan los usuarios; asimismo, distribuye gratuitamente su propia revista de manera virtual (digital), en la cual se muestran nuevas estrategias de manejo de portafolios, entre otros temas de interés.
- El Servicio de una solución financiera ofrece capacitación en diferentes campos, como gestión de carteras, gestión de riesgos, entre otros, *webinars* con temas de coyuntura económica y financiera.
- La información se integra en un solo lugar y se entrega a través de la terminal.
- Información sobre mercado de bonos, con gráficos de rentabilidad, spreads y rendimiento histórico de las divisas locales.
- Aplicativos para generar benchmark para instrumentos del portafolio.
- Medición de ganancias de bonos en un periodo específico, teniendo en cuenta el interés local devengado y las convenciones de precios.
- Monitoreo de fluctuaciones en los spreads del sector, la proporción entre el aumento y la reducción de los spreads de los bonos, y el volumen acumulativo de nuevas emisiones de la semana.
- Calculadora completa y robusta que permite calcular los precios y tasas de mercado requeridos para la negociación.
- Información en meses, días, horas, minutos, segundos que permite ahorrar tiempo y profundizar el análisis con información actualizada.
- Administrar todos los instrumentos de todas las carteras a través de la herramienta PORT o similares.
- Conocer posición de tenedores de bonos de menor rezago. En la medida que sea posible ya que son mercados no centralizados.
- Integración con el sistema de gestión de órdenes, de tal manera que los equipos de tesorería y contabilidad pueden garantizar la fluidez de su trabajo y disminuir errores.
- Monitorear los rendimientos relativos e históricos de los mercados de renta fija, renta variable e inversiones alternativas.
- Permite ubicar información sobre los mercados de bonos mundiales desde una única ubicación para que se pueda hacer más en menos tiempo.

V. LUGAR Y PLAZO DE EJECUCIÓN (Obligatorio)

- Lugar: Lima metropolitana.
- Plazo de ejecución: el plazo de ejecución del servicio será por 24 meses, contados a partir de suscrito el Acta de Implementación.

VI. ENTREGABLES (Obligatorio)

| N° | Cantidad | Detalles |
|----|----------|--|
| 1 | 1 | Licencia de servicio de consulta en línea de datos y análisis de información financiera, el cual iniciará a partir del día siguiente de la firma del contrato. |
| 2 | 1 | Una Pantalla doble de 23" con su parante de base propio. |
| 3 | 1 | Un CPU |
| 4 | 1 | Un teclado Bloomberg. |
| 5 | 1 | Un Mouse |

La licencia es recibida dentro de los próximos 5 días luego de la firma del contrato, a través de la instalación física del equipo (computadora, teclado y pantalla) en las instalaciones de la Gerencia de

| |
|--|
| Inversiones de la CPMP; cuyo reporte de la llegada e implementación es el acta de implementación firmada entre el proveedor y el área usuaria. |
| VII. CONFORMIDAD (Obligatorio) |
| La conformidad del servicio será dada por la Gerencia de Inversiones de la CPMP. |
| VIII. FORMAS Y CONDICIONES DE PAGO (Obligatorio) |
| <p>LA ENTIDAD se obliga a pagar la contraprestación a EL CONTRATISTA en Dólares Americanos, en OCHO (08) PAGOS PARCIALES POR ADELANTADO TRIMESTRALMENTE, luego de la recepción formal y completa de la documentación correspondiente, según lo establecido en el artículo 171° del Reglamento de la Ley de Contrataciones del Estado.</p> <p>Para efectos del pago de la contraprestación ejecutada por EL CONTRATISTA, LA ENTIDAD debe contar con la siguiente documentación:</p> <ul style="list-style-type: none"> - La conformidad del servicio, que estará a cargo de la GERENCIA DE INVERSIONES de LA ENTIDAD. - Comprobante de pago. <p>Para tal efecto, el responsable de otorgar la conformidad de la prestación deberá hacerlo en un plazo que no excederá de los siete (07) días de producida la recepción, salvo que requiera efectuar pruebas que permitan verificar el cumplimiento de la obligación, en cuyo caso la conformidad se emite en un plazo máximo de quince (15) días, bajo responsabilidad de dicho funcionario.</p> |
| X. CONFIDENCIALIDAD (Obligatorio) |
| <p>La obligación de guardar confidencialidad, se entenderá cumplida en la medida en que EL CONTRATISTA realice los esfuerzos comercialmente razonables conducentes a guardar confidencialidad sobre la información confidencial de LA ENTIDAD. Para tales efectos, la información confidencial de LA ENTIDAD se limitará a:</p> <ul style="list-style-type: none"> (i) Todos los e-mails, sus adjuntos y mensajes instantáneos, y sus respectivos contenidos, enviados o recibidos por LA ENTIDAD vía el servicio BLOOMBERG TERMINAL (los "Records"), y (ii) data financiera que LA ENTIDAD ingrese al servicio BLOOMBERG TERMINAL que sea de naturaleza confidencial o de dominio privado, tal como posiciones de trading y portafolio y/o estrategias de trading (la "Información Confidencial"). LA ENTIDAD reconoce que en el curso de su actividad EL CONTRATISTA puede revelar Información Confidencial a sus afiliados, proveedores de servicios y sus respectivos empleados y agentes (todos conjuntamente, "Representantes"), entendiéndose que EL CONTRATISTA será responsable por cualquier violación de la Obligación de Confidencialidad por parte de los Representantes. |

Firmado digitalmente por:

Anthony Kevin Tineo Nieves

Gerente de Inversiones