35 (Treinta y cinco)

BANCO CENTRAL DEL PARAGUAY
UNIDAD OPERATIVA DE CONTRATACIÓN

DICTAMEN UOC/BCP/ N° 0003/ 2012

Asunción, 17 de abril de 2012

CONTRATACIÓN POR EXCEPCIÓN N° 7PM/12 PARA EL SERVICIO DE SUSCRIPCIÓN AL MÓDULO AIM DE ADMINISTRACIÓN DE RESERVAS - BLOMBERG PARA EL BANCO CENTRAL DEL PARAGUAY"

a) Descripción de la Contratación.

"CONTRATACIÓN DEL SERVICIO DE SUSCRIPCIÓN AL MÓDULO AIM DE ADMINISTRACIÓN DE RESERVAS - BLOMBERG PARA EL BANCO CENTRAL DEL PARAGUAY"

b) Justificación de necesidad de la Contratación.

Por memorando **DAR/DCR N° 0007/12** de fecha 20 de marzo del 2012, el Departamento de Administración de Reservas dependiente de la Gerencia de Reservas y Servicios Financieros y la Subgerencia General de Operaciones Financieras, justifica la suscripción al servicio informativo de la firma BLOOMBERG, fundamentando, que esta red interactiva de información financiera constituye la base fundamental de todo el conjunto de servicios de Bloomberg. Esta sofisticada plataforma integra bases de datos, noticias, gráficos, calculadoras, e-mail, información multimedia y herramientas de negociación electrónica en un producto global, equipado con la tecnología necesaria para ofrecer acceso seguro y fiable a los mercados internacionales. Más de 260.000 profesionales utilizan diariamente el conjunto de funciones que BLOOMBERG pone a disposición de sus usuarios herramientas para analizar estrategias y negociar en bolsa, 24 horas al día, 7 días a la semana. Los servicios de esta firma, no son igualados por ninguna otra similar.

El actual software de Administración de Reservas no cumple con todo lo que requiere una eficiente administración de los activos externos. El constante incremento de las Reservas Internacionales, así como las nuevas Normas para la Administración de los Activos Externos del BCP, la diversidad de los mercados financieros y las nuevas técnicas de administración de riesgos, exigen que el área cuente con un software especializado, que contenga una plataforma ya predeterminada de cálculos financieros de acuerdo al estándar internacional, que tenga acceso práctico a bases de datos de sistemas de información financiera como Bloomberg, y que pueda automatizar los procesos e integración de los tres sectores involucrados en las operaciones (Front Office – Back Office – Swift), es decir, generación de boletas de operaciones, interface con el sistema Swift para la automatización de los mensajes de confirmaciones y órdenes de pago, de manera a agilizar el proceso evitando intervenciones manuales, reduciendo así el riesgo operativo, además de la automatización de los registros contables de las operaciones dentro del sistema contable del Banco, devengamiento de intereses de las inversiones, control y monitoreo de las operaciones enmarcadas dentro de las Normas para la Administración de los Activos Externos (Compliance), flexibilidad en el acceso a la base de datos contenidos en el sistema, para el análisis y generación de informes.

Asimismo cabe resaltar que, ante la necesidad de actualizar el Sistema Informático de Administración de Reservas, se ha contratado los servicios del sistema Asset and Investment Manager (AIM) de la misma firma BLOOMBERG, que permitirá la

Alba Patricia Galeano
UOC - BCP

Fredes Ortiz

BANCO CENTRAL DEL PARAGUAY
UNIDAD OPERATIVA DE CONTRATACIÓN

36 (Treinta y seis)

DICTAMEN UOC/BCP/ N° 0003/ 2012

integración de las operaciones de reservas entre en Front, Back y Middle Office del DAR. El sistema AIM es operado a través de las mismas terminales del sistema BLOOMBERG. El mismo posibilitará la automatización de todos los procesos de operaciones de inversión, desde el inicio con los operadores de la División Activos Externos, las confirmaciones y pagos de la División Procesos (SWIFT), y los controles de riesgo y compliance de la Unidad de Control de Riesgos. Esta automatización posibilitará, además de un control adecuado de los riesgos y el mantenimiento de los parámetros establecidos en las Normativas de Reservas, la disminución de las intervenciones manuales, con el consecuente aumento en la rapidez y eficiencia, y la minimización de los riesgos operativos.

El proceso de implementación del sistema AIM ya ha sido iniciado y, debido a que dicho sistema se opera a través de las terminales de Bloomberg, es necesario contar con 4 (cuatro) terminales más para todas las áreas usuarias, de manera a cumplir con las exigencias de dicho programa para completar la automatización requerida.

c) Marco Legal

La disposición legal que regula la materia es el **Art. 33° de la Ley N° 2051/03** "De Contrataciones Públicas" que establece los casos excepcionales en los siguientes términos: "*Las convocantes bajo su responsabilidad, podrán llevar a cabo los procedimientos de contratación, sin sujetarse a los de la Licitación Pública o a los de Licitación por Concurso de Ofertas, en los supuestos que a continuación se señalan….", "…g) existan razones justificadas para la adquisición o locación de bienes* ***por razones técnicas****…"*

d) Supuesto de la Excepción para la Contratación

Considerando lo expuesto en el punto b) Justificación de necesidad de la contratación, se concluye que el programa AIM de Bloomberg constituye una sofisticada herramienta de análisis y control de operaciones, posiciones, performance, riesgo y compliance, reportes, así como una integración total de las operaciones entre el front y back office, así como la integración a otros sistemas como la contabilidad, cuentas corrientes y SWIFT.

Cabe señalar, que este programa es utilizado además por otros Bancos Centrales de la zona, como Bolivia, Ecuador, Venezuela entre otros, por ser el que mejor se ajusta a las necesidades y objetivos de la Administración de las Reservas del Banco Central del Paraguay.

La División Activos Externos se encargará de realizar las operaciones de inversiones y compra/venta de divisas dentro del sistema AIM utilizando las terminales de BLOOMBERG. El AIM le permitirá elaborar estrategias, visualizando la posición de la cartera contra el benchmark, y servirá como soporte en la toma de decisiones, generación de tickets de operaciones y actualización de las posiciones.

e) Conclusión.

En base a todo lo expuesto y considerando los antecedentes suministrados por la Departamento de Administración de Reservas dependiente de la Gerencia de

Lic. Patricia Galeano Cesar Fredes Ortiz

BANCO CENTRAL DEL PARAGUAY
UNIDAD OPERATIVA DE CONTRATACIÓN

37 (Treinta y Siete)

DICTAMEN UOC/BCP/ N° 0003/ 2012

Operaciones Internacionales y atendiendo a los términos del ***Art. 33º, inciso g) "razones técnicas"*** de la Ley Nº 2051/03 "De Contrataciones Públicas", esta Unidad entiende que, existen razones suficientes y fundadas para que la contratación al Servicio de Suscripción al Módulo AIM de Administración de Reservas de estos instrumentos de la firma **BLOOMBERG**, se realice bajo la modalidad de contratación por la vía de excepción, motivado en una justificación altamente técnica conforme a las características del servicio ofrecido, basado en los fundamentos esgrimidos en los incisos "b y d" de este dictamen. Para el efecto, corresponde que la máxima autoridad acredite el supuesto de excepción mediante Resolución administrativa.

ALBA PATRICIA GALEANO ZÁRATE
Jefa de División
Compras Mayores

CÉSAR FRETES ORTÍZ
Encargado de Despacho
Unidad Operativa de Contratación