La banca pública de promoció

PLEC DE PRESCRIPCIONS TÈCNIQUES PER A LA CONTRACTACIÓ DEL SUBMINISTRAMENT DE LA LLICÈNCIA I ELS SERVEIS DE MANTENIMENT PREVENTIU, CORRECTIU I SUPORT A L'USUARI DEL SOFTWARE FIS BALANCE SHEET MANAGER DESENVOLUPAT PER FIS GLOBAL TRADING IBÈRICA, S.L. PER L'INSTITUT CATALÀ DE FINANCES.

1.- OBJECTE DEL CONTRACTE

L'objecte del present plec és fixar les prescripcions tècniques que regiran la contractació del subministrament de la llicència del software FIS BALANCE SHEET MANAGER (anteriorment AMBIT FOCUS) així com els serveis de manteniment preventiu, correctiu i suport a l'usuari del precitat software desenvolupat **per FIS GLOBAL TRADING IBÈRICA, S.L. per l'Institut Català de Finances** (en endavant ICF).

Aquest software és un aplicatius de gestió de balanç que permet integrar dades gestionades per altres aplicatius, com són la part d'actiu, gestionat amb l'eina SIG, que integrava dades de la inversió creditícia, i la part de passiu, gestionat amb l'eina FIT, que integrava dades de la cartera d'inversió i de l'endeutament. El que permet un control i una gestió integrada dels riscos estructurals de balanç. Així mateix l'eina ha permès la migració de les dades al nou core bancari IRIS.

El detall de les prestacions compreses al contracte es troba descrit a l'apartat tercer del present plec de prescripcions tècniques.

2.- LLICÈNCIA D'ÚS DEL SISTEMA

L'ICF vol adquirir una llicència d'ús no exclusiu i no transferible del software FIS BALANCE SHEET MANAGER.

El software de la llicència inclourà els següents mòduls funcionals inter operables sobre una capa de dades comuna:

1. Asset-Liability Management Module
    a. Informes de gap de repricing i liquiditat.
    b. Models de comportament (behavioural modelling).
    c. Sensibilitat al valor econòmic (EVE) – Delta i Duració.
    d. Descomposició de marges al càlcul del Delta EVE.
    e. Escenaris ALM i projecció del marge d'interessos (NII).
    f. Escenaris de factors de risc.
    g. Planificació i optimització del balanç.
    h. Resultats de simulació.

2. Liquidity Risk Module.
    a. Càlcul diari de ràtios reguladores: Liquidity Coverage Ratio (LCR) i Net Stable Funding Ratio (NSFR).

b. Anàlisi prospectiva de les ràtios de liquiditat (LCR i NSFR) sota diferents escenaris.
c. Gestió del volum i dels costos del coixí d'actius líquids d'alta qualitat.
d. Mesurament i previsió de gaps de liquiditat, incloent l'anàlisi sota escenaris d'estrès.
e. Seguiment de la suficiència de liquiditat i de l'horitzó de supervivència.
f. Definició, seguiment i previsió de mètriques internes específiques de l'entitat, com la capacitat de contrapès (basada en els valors d'actius pignorats i no pignorats), la posició neta de liquiditat, etc.
g. Pricing de la liquiditat (en combinació amb un marc més ampli de Funds Transfer Pricing).
h. Desenvolupament de plans de contingència i proves de la seva eficàcia sota diferents escenaris d'estrès.

3. Capa de gestió de dades – DataHub: el software incorpora una capa integrada de gestió de dades que garanteix la qualitat, consistència i traçabilitat de la informació.

El destinatari de la llicència és l'àrea de control global del risc i l'àrea de tresoreria i mercat de capitals i, en concret, amb dos usuaris contractats, adaptat a les necessitats operatives de riscos del grup.

La llicència es concedirà únicament a ICF, sense que aquest pugui fer-la extensiva a cap entitat del seu grup, i es concedirà per a la utilització de l'aplicatiu amb la finalitat exclusiva de permetre-li portar a terme el control i gestió dels riscos estructurals del seu propi balanç.

3.- CARACTERÍSTIQUES DEL SERVEI

El present contracte inclou la prestació del **servei de manteniment correctiu i preventiu i suport als usuaris del software, en concret**

I. L'adjudicatari garantirà el manteniment correctiu i preventiu de la solució durant el període contractual, així com les evolucions tècniques de la infraestructura del producte FIS BALANCE SHEET MANAGER per evitar l'obsolescència tecnològica dels elements de la solució. Per assolir-ho, les responsabilitats de suport abasten les àrees següents,:
   a. subministrament de noves versions;
   b. consulta i suport telefònic i per correu electrònic pel que fa a l'ús i l'operació de la Solució; i
   c. suport per a Incidències.

II. S'establirà un acord de nivell de servei (SLA), per resoldre les peticions de resolucions d'incidències, fixant l'ICF el nivell de prioritat de les solucions als incidents de producció en 4 nivells, amb un temps màxim de resolució d'aquestes incidències:
   a. Prioritat 1: crítica (temps de resposta previst: 4 hores)

b. Prioritat 2: greu (temps de resposta previst: 6 hores)
c. Prioritat 3: moderada (temps de resposta previst: 2 dies hàbils)
d. Prioritat 4: nominal (temps de resposta previst: 5 dies hàbils)

III. L'adjudicatari oferirà aquest suport dins el següent horari:

Dilluns a divendres de 9:00am – 5:00 pm (hora local de Zurich), excloent els dies festius de FIS

IV. L'adjudicatari aportarà el correu electrònic i el número de telèfon de les persones que realitzaran aquest suport.

4.- ALTRES OBLIGACIONS

FIS GLOBAL TRADING IBÈRICA, S.L., es compromet a comptar amb personal degudament qualificat per a dur a terme l'execució del contracte.