



PERÚ

Ministerio de
Economía y Finanzas

Oficina General de
Tecnologías de la Información

INFORME TÉCNICO PREVIO DE EVALUACIÓN DE SOFTWARE

Nº 009-2013-EF/OGTI

Herramienta de Software para el Análisis de Decisiones y
Riesgo @Risk





PERÚ

Ministerio de
Economía y FinanzasOficina General de
Tecnologías de la Información

INFORME TÉCNICO PREVIO DE EVALUACIÓN DE SOFTWARE

1. NOMBRE DEL AREA

Oficina General de Tecnologías de la Información (OGTI)

2. RESPONSABLES DE LA EVALUACIÓN

Julio Molina Gárate
Ivan Llaque Torres

3. CARGOS

Director General (e) de la Oficina de Tecnologías de la Información
Especialista de la Oficina de Tecnologías de la Información

4. FECHA

03/04/2013

5. JUSTIFICACIÓN

La Dirección General de Endeudamiento Público - DGETP del Ministerio de Economía y Finanzas - MEF, tiene como una de sus principales funciones del diseño de las estrategias y políticas para la gestión y valoración de riesgos financieros operativos y contingentes fiscales de naturaleza jurídica y contractual, o derivados de desastres naturales.

La Dirección de Gestión de Riesgos de la DGETP tiene como unas de sus funciones principales la de diseñar, monitorear y proponer políticas, directrices y estrategias de gestión de riesgos financieros, operativos y contingentes fiscales de naturaleza jurídica y contractual; una de sus tareas específicas es la del análisis tradicional de los beneficios a valor presente que comprende cualquier evaluación económica financiera de un proyecto, resulta indispensable complementar dicha evaluación con un adecuado análisis probabilístico de los riesgos financieros que conlleva el proyecto evaluado.

Actualmente, la DGETP carece de la herramienta de software @RISK, lo cual impide una labor eficiente y eficaz en las evaluaciones y validaciones de los diversos proyectos que son presentados a dicha Dirección General en el marco de sus funciones generales. Es por ello que se hace indispensable contar con ésta herramienta de análisis y simulación de riesgos financieros para el cumplimiento de dichos objetivos.

6. ALTERNATIVAS

Para el presente análisis, de acuerdo a las sugerencias proporcionadas por la DGETP y a la investigación de mercado realizada, se optó por la evaluación de los siguientes productos disponibles en el ámbito local:

- @Risk, del fabricante Palisade Corporation.
- Crystal Ball, del fabricante Oracle Corporation.
- Risk Simulator, del fabricante Real Options Valuation.

Para efectos de la valoración de costos, se ha considerado la adquisición de una (01) licencia de software.

7. ANÁLISIS COMPARATIVO TÉCNICO

Se realiza una evaluación técnica de acuerdo a lo dispuesto en la Parte 3 de la "Guía Técnica sobre Evaluación de Software en la Administración Pública", aprobada por Resolución Ministerial N° 139-2004-PCM.

a) Propósito de la evaluación

Comparar las características de los productos software identificados como disponibles en el mercado nacional, seleccionando aquellos que satisfagan las necesidades manifestadas por las correspondientes áreas usuarias del MEF.



PERÚ

Ministerio de
Economía y FinanzasOficina General de
Tecnologías de la Información**b) Tipo de producto**

Software de análisis y simulación de riesgos en modelos económico-financieros.

c) Modelo de calidad

De acuerdo al modelo de calidad descrito en la Parte 1 de la guía de evaluación de software mencionada y en coordinación con las áreas usuarias involucradas, se determinaron los atributos relacionados con características de funcionalidad y usabilidad que deberán reunir las alternativas a ser evaluadas.

Las características identificadas son requeridas por las áreas usuarias para el adecuado cumplimiento de sus funciones. La descripción de dichos atributos se presenta en el Cuadro N° 1 de resultados de la evaluación técnica.

d) Métricas

Cada atributo considerado es calificado con los siguientes criterios y escalas:

Criterio de Calificación	Escala de Puntuación
Cumple totalmente	4 puntos
Cumple parcialmente	2 puntos
No cumple	0 puntos

Puntaje Mínimo de Aceptación

Para cada alternativa evaluada, su **"Puntaje de Evaluación Técnica (PET)"** es la suma de las puntuaciones obtenidas al valorar sus atributos.

El **puntaje mínimo de aceptación** de una alternativa será el de un PET mayor o igual a **80 puntos**.

e) Evaluación técnica

En el siguiente cuadro se muestran los PET obtenidos para las alternativas evaluadas:

Cuadro N° 1: Evaluación técnica

Nº Item	Atributo	Puntaje máximo	Alternativa		
			Risk Simulator	Crystal Ball ⁽¹⁾	@Risk ⁽²⁾
Análisis Estadístico					
01	Ajuste distribucional sobre información existente	4	4	4	4
02	Análisis de escenario	4	4	4	4
03	Análisis de sensibilidad	4	4	4	4
04	Simulación no paramétrica	4	4	4	4
05	Tablas de tornado y araña	4	4	4	4
Pronósticos					
06	Análisis de series de tiempo	4	4	4	4
07	Análisis de regresión múltiple	4	4	4	4
Simulación de Monte Carlo					
08	Métodos tradicionales Monte Carlo	4	4	4	4
09	Variedad de distribuciones estadísticas, incluyendo distribución personalizable empírica sin parámetros	4	4	4	4
10	Simulación comprensiva con reportes analíticos	4	4	4	4
11	Simulación correlacionada con truncamiento distribucional	4	4	4	4
12	Simulaciones multidimensionales con parámetros iniciales inciertos	4	4	4	4
13	Permite compartir modelos de simulación	4	4	4	4
14	Análisis de estrés	4	0	0	4
15	Estimación por árboles de decisión	4	0	0	4





PERÚ

Ministerio de
Economía y FinanzasOficina General de
Tecnologías de la Información

Nº Item	Atributo	Puntaje máximo	Alternativa		
			Risk Simulator	Crystal Ball ⁽¹⁾	@Risk ⁽²⁾
16	Diagramas de influencia con árboles de decisión	4	0	0	4
17	Programación de simulaciones	4	0	0	4
Optimización					
18	Optimización con variables enteras discretas, continuas y con mezcla de ambas	4	4	4	4
19	Optimización dinámica (simulación con optimización)	4	4	4	4
20	Optimización estática (estimación rápida de puntos) y análisis de fronteras eficientes	4	4	4	4
21	Optimización lineal	4	4	4	4
Otras características					
22	Integración completa con Excel (vínculos dinámicos, macros VBA)	4	4	4	4
23	Software y documentación en idioma español	4	4	4	4
24	Requerimiento operativo: interoperable con modelos elaborados en @Risk	4	0	0	4
25	Requerimiento operativo: interoperable con modelos elaborados en Crystal Ball	4	0	4	0
Puntaje de Evaluación Técnica – PET		100	76	80	96

(1) El producto comparado es la edición Crystal Ball + Decision Optimizer.

(2) El producto comparado es la edición DecisionTools Suite (DTS) Professional

f) Alternativas técnicamente aceptables

Las siguientes alternativas han igualado o superado el Puntaje Mínimo de Aceptación en la evaluación técnica, al haber obtenido los Puntajes de Evaluación Técnica señalados:

- Crystal Ball (PET = 80 puntos), edición Crystal Ball + Decision Optimizer.
- @Risk (PET = 96 puntos), edición DTS Professional

8. ANÁLISIS COMPARATIVO DE COSTO – BENEFICIO

Este análisis comparativo de costo-beneficio se ajusta a lo dispuesto en el Artículo 7º del D.S. N° 024-2006-PCM, teniendo en cuenta los detalles indicados en el punto 8 del Anexo respectivo.

a) Metodología

El análisis comparativo de costo – beneficio se llevará a cabo de la siguiente manera:

- Solo se incluye en este análisis toda alternativa técnicamente aceptable, es decir, cuya evaluación técnica haya arrojado un PET igual o superior al puntaje mínimo de aceptación indicado en el Análisis Comparativo Técnico.
- Para cada alternativa, se efectúa una valoración cuantitativa de los beneficios adicionales que se estimen pertinentes, obteniéndose un factor denominado Puntaje de Beneficios Adicionales (PBA).
- Se considera que tanto los resultados de la evaluación técnica como los de la valoración de beneficios adicionales contribuyen a la cuantificación del beneficio total ofrecido por cada alternativa.
- Se determinan los costos totales de adquisición (CT) de cada alternativa.
- Se define el **Coeficiente de Costo Beneficio (CCB)** con la siguiente fórmula:

$$CCB = \frac{PET + PBA}{CT}$$

- vi. Se calcula el CCB para cada alternativa.





PERÚ

Ministerio de
Economía y FinanzasOficina General de
Tecnologías de la Información

vii. Se establecerá como recomendable toda alternativa evaluada que haya alcanzado un **CCB mayor o igual a 2.5**.

b) Beneficios adicionales

Para el presente análisis, dentro de los beneficios mencionados en el Anexo del D.S. 024-2006-PCM, se han considerado como adicionales solo aquellos conceptos que constituyan características diferenciadoras, tal como se muestran más abajo en el Cuadro N° 2. No se han incluido otros conceptos enunciados como mínimos en el numeral 8 de dicho Anexo, al no juzgárseles pertinentes para esta evaluación por los motivos señalados a continuación:

- *Hardware necesario para su funcionamiento*: ninguna de las alternativas evaluadas requiere hardware adicional.
- *Personal y mantenimiento interno*: no se requiere capacidad de modificación del código fuente del producto a adquirir.

Cada concepto considerado es calificado con los siguientes criterios y escalas:

Criterio de Calificación	Escala de Puntuación
Cumple totalmente	5 puntos
Cumple parcialmente	2 puntos
No cumple	0 puntos

Para cada producto evaluado, su "**Puntaje de Beneficios Adicionales (PBA)**" es la suma de las puntuaciones obtenidas al calificar los conceptos considerados.

En el siguiente cuadro se muestran los PBA obtenidos por cada alternativa técnicamente aceptable:

Cuadro N° 2: Valoración de beneficios adicionales

Nº Item	Conceptos	Puntaje máximo	Alternativa ⁽¹⁾	
			Crystal Ball	@Risk
Licenciamiento				
01	Licenciamiento tanto concurrente (en red) como individual (por equipo)	5	2	5
Soporte y mantenimiento externo				
02	Actualización de licencias y soporte técnico por períodos anuales	5	5	5
Capacitación				
03	Entrenamiento teórico práctico básico incluido	5	5	0
04	Certificación por participante	5	5	5
Puntaje de Beneficios Adicionales (PBA)		20	17	15

(1) Los productos correspondientes están indicados al pie del Cuadro N° 1.

c) Costos

En el siguiente cuadro, para cada alternativa técnicamente aceptable se muestra su "**Costo Total (CT)**", definido como la suma de los costos de licenciamiento y de todo beneficio adicional comparable. Los montos mostrados provienen de valores de mercado obtenidos mediante presupuestos referenciales de diferentes proveedores.

Cuadro N° 3: Costos

Alternativa	Costo en miles de Soles (sin IGV)			Costo Total (CT = L + M + C)
	Licenciamiento (L)	Mantenimiento (M)	Capacitación (C)	
Crystal Ball	8.12	0.00	0.00	8.12
@Risk	6.41	0.00	0.00	6.41

d) Evaluación costo-beneficio

Por último, en el siguiente cuadro se muestran los resultados obtenidos al calcular los respectivos coeficientes de costo-beneficio para las alternativas evaluadas:



PERÚ

Ministerio de
Economía y FinanzasOficina General de
Tecnologías de la Información

Cuadro N° 4: Evaluación costo-beneficio

Alternativa	PET	PBA	CT	CCB
Crystal Ball	80	17	8.12	11.95
@Risk	96	15	6.41	17.32

e) Alternativas recomendables

Se establecen como recomendables las siguientes alternativas, al haber igualado o superado el valor mínimo de CCB indicado en el punto vii) de la metodología descrita:

- Crystal Ball (CCB = 11.95), edición Crystal Ball + Decision Optimizer.
- @Risk (CCB = 17.32), edición DTS Professional.

9. CONCLUSIONES

De acuerdo a los resultados obtenidos en el Análisis Comparativo Técnico y en el Análisis Comparativo de Costo – Beneficio del presente Informe Técnico Previo de Evaluación de Software, se concluye que las alternativas Crystal Ball (edición Crystal Ball + Decision Optimizer) y @Risk (edición DTS Professional) cumplen con los criterios de aceptación establecidos y, por lo tanto, satisfacen adecuadamente los requerimientos solicitados.

10. FIRMAS

Responsable(s) de la evaluación:

Responsable	Cargo	Firma
Julio Molina Gárate	Director General (e) de la Oficina General de Tecnologías de la Información	
Ivan Llaque Torres	Especialista de la Oficina de Tecnologías de la Información.	

