

Praha 22. května 2013
Č.j.: 2013-1851-420

**Odpovědi zadavatele na dotazy k veřejné zakázce „Risk Management System“
– 4. série**

Zadavatel níže uvádí odpovědi na dotazy uchazeče:

Dotaz č. 1:

Real time mód - jakým způsobem máme chápat operační mód aplikace? Očekáváte systém, který bude napojen na "živé", real time, zdroje dat a bude v reálném čase přepočítávat jednotlivá risk management kritéria, výkonnost portfolií apod.? Anebo očekáváte systém, který bude jednou, nebo několikrát za den, aktualizován vstupními daty a v rámci této aktualizace dojde na základě požadavku k přepočítání risk mgmt kritérií a dalších ukazatelů?

Odpověď zadavatele:

Požadavek, aby systém zajišťoval, že míry durace, value-at-risk a ostatní míry tržního rizika se aktualizují/přepočítávají alespoň jedenkrát denně v určitý předem daný čas, je zařazen mezi povinné požadavky a pod označením MR-02 je obsažen v příloze č. 1 návrhu smlouvy (příloha č. 1 ZD), přičemž stejný mód je požadován na ostatní parametry portfolia.

Požadavek, aby systém zajišťoval, že durace se přepočítává po každém vložení obchodu do systému a po každé změně ceny, je zařazen mezi vítané požadavky a pod označením MR-51 je tento požadavek obsažen v příloze č. 1 návrhu smlouvy (příloha č. 1 ZD). Rizikově upravené míry, volatility, směrodatné odchylky, bezrizikové sazby, beta a benchmark se aktualizují/přepočítávají pokaždé, když se změní portfolio nebo benchmark, patří rovněž mezi vítané požadavky (příloha č. 1 návrhu smlouvy) i vzhledem k ostatním parametrům portfolia.

Dotaz č. 2:

Požadavek BM-04 - můžete prosím upřesnit význam zkratky DR?

Odpověď zadavatele:

DR = Devizové Rezervy ČNB.

Dotaz č. 3:

Benchmark data vnímáme jako jeden ze vstupů pro RiskMS. Je toto vnímání správné?

Odpověď zadavatele:

Ano. BM-07 Systém importuje indexy od externích poskytovatelů tržních dat, aby mohly být vytvořeny a udržovány benchmarky založené na tržních indexech.

Dotaz č. 4:

Jaké typy dat máme očekávat z datových rozhraní systému ISFO a Bloomberg? Bude vyžadováno napojení na Reuters popř. na další externí datové zdroje (brokery)?

Odpověď zadavatele:

Zadavatel požaduje v souladu se zněním kapitoly 1.2 VAZBY NA EXTERNÍ ZDROJE A SLUŽBY SYSTÉMOVÉHO PROSTŘEDÍ obsažené v příloze č. 2 návrhu smlouvy (příloha č. 1 ZD) napojení na ISFO a Bloomberg. Napojení na Reuters je vítané, ale není požadováno. ISFO bude poskytovat informace o provedených obchodech a Bloomberg bude sloužit jako zdroj tržních dat.

Dotaz č. 5:

Jak je definován "počet portfolií" (e.g. na desk, na produkt, na segment, ...) a mají být oddělena zmíněná "interně/externě spravovaná" portfolia (e.g. náhled, kompetenční pravidla pracovníků dle seniority, ...)? Co je myšleno pod pojmem "Externě spravované portfolio" v případě ČNB?

Odpověď zadavatele:

Portfolio je definováno měnou, typem investice (fixed income, akcie, měnová expozice) a způsobem správy (interní/externí), tj. interní a externí portfolia jsou oddělena. Externě spravované portfolio je portfolio investic spravované externím správcem, tj. jinou institucí než ČNB a se kterou má ČNB smluvní vztah definující způsob správy svěřených prostředků.

Dotaz č. 6:

Co je myšleno "neagregováním přes cenné papíry" v definování pozic u "Počtu otevřených pozic v jednom portfoliu"?

Odpověď zadavatele:

To znamená, že dva obchody s jedním (stejným) cenným papírem, ať už nákupy, prodeje nebo jejich kombinace jsou považovány za dvě pozice.

Dotaz č. 7:

Bude součástí požadavku pro modul Operačních rizik i ocenění procesů/produktů v bance na základě benchmarku trhu (centrálních bank)?

Odpověď zadavatele:

Toto je vítaná funkcionalita (viz kapitola 1 CÍLE SYSTÉMU obsažené v příloze č. 1 návrhu smlouvy).

Dotaz č. 8:

Vzhledem k požadavkům ČNB na řízení, měření a vyhodnocování kontrol v instituci - má banka v úmyslu propojit Risk Management System s auditním systémem (i.e. Plánování, processing, follow up, ...)?

Odpověď zadavatele:

V současnosti zadavatel takový úmysl nemá.

Dotaz č. 9:

Předpokládá se výpočet (e.g. VaR) včetně zdrojových informací i pro komodity (event. komoditní portfolio)? Jaké další typy výpočtu pro komoditní instrumenty předpokládáte?

Odpověď zadavatele:

V současnosti zadavatel takový úmysl nemá. Obchody s komoditami (kromě zlata) nejsou v tomto okamžiku schváleným investičním nástrojem.

Dotaz č. 10:

Předpokládají se v systému role (vstupy, výstupy) i pro další útvary banky (Back Office, Middle Office, etc.)?

Odpověď zadavatele:

Role v systému jsou popsány v kapitole 2 CHARAKTERISTIKA ROLÍ UŽIVATELŮ (SKUPINY ROLÍ UŽIVATELŮ) obsažené v příloze č. 1 návrhu smlouvy, viz níže:

- Administrátor systému RiskMS – 2 zaměstnanci sekce informatiky,
- Risk manager – až 4 zaměstnanci ČNB,
- Uživatel – až 20 zaměstnanců dealingu ČNB,

kde zaměstnancem dealingu se rozumí zaměstnanec na pracovní pozici Dealer, Back Office, Middle Office a Risk Management.

Dotaz č. 11:

Je možné, aby školení administrátorů proběhlo v anglickém jazyce?

Odpověď zadavatele:

Ze znění čl. XV odst. 3 návrhu smlouvy vyplývá, že veškerá komunikace mezi smluvními stranami vztahující se k této smlouvě bude probíhat v českém nebo slovenském jazyce, nebude-li smluvními stranami v konkrétním případě dohodnuto jinak. Smluvní strany se tedy mohou domluvit na zaškolení v angličtině.

Dotaz č. 12:

Článek V, bod 1 písmeno e) návrhu smlouvy - je licenci za "Software - klientská strana" myšlena cena licenci za vlastní RiskMS a cenou za "Software - serverová strana" myšlena cena licenci spojených s dodávkou případné infrastruktury (např. licence za OS nebo podobně)?

Odpověď zadavatele:

S ohledem na to, že zadavatel nezná dopředu návrh řešení systému RiskMS, je věcí dodavatele, jak cenu SW (licenci) rozdělí. Rozdělení na serverovou (např. serverové operační systémy, databáze, aplikační frameworky, licence RiskMS vycházející z počtu serverů či dat atd.) a klientskou část (licence RiskMS na uživatele, aplikační frameworku, podpůrný krabicový SW apod.) je čistě orientační a v návaznosti na návrh řešení RiskMS je možné smlouvu uzavíranou s vybraným dodavatelem upravit dle skutečnosti.

Dotaz č. 13:

Bude dodavateli povoleno nahlédnout a následně provádět rekongiliaci předpokládaných požadavků v interních směrnících ČNB s funkčnostmi nabízeného systému? (Vzhledem k požadavkům na RiskMS a jejich korelaci na ad1 Pokyny o rozvoji IT/IS v ČNB, ad2 Pokyny o provozování a správě produktů a služeb IS/IT v ČNB, ad3 Pokyny o bezpečnostní politice ČNB v oblasti IT).

Odpověď zadavatele:

Po uzavření smlouvy s vybraným dodavatelem je možné při implementaci systému RiskMS nechat dodavatele do vybraných ustanovení výše uvedených předpisů, nezbytných pro plnění smlouvy, nahlédnout. Část Pokynů o provozování a správě produktů a služeb IS/IT v ČNB (ad2) a Pokynů o bezpečnostní politice ČNB v oblasti IT (ad3) jsou již obsaženy ve příloze č. 2 návrhu smlouvy - Technické zadání informačního systému RiskMS a organizační standardy. V případě Pokynů o rozvoji IT/IS v ČNB(ad1) jsou tyto pokyny relativně na funkčních požadavcích obsažených v příloze č. 2 návrhu smlouvy nezávislé a hlavní projekční postupy jsou uvedeny v příloze č. 3 návrhu smlouvy - Organizace a řízení projektu.

Ing. Zdeněk Virius
ředitel sekce správní
podepsáno elektronicky