

# Derivados Cambiarios – Según Residencia de Contraparte

Encuesta Trimestral de Balanza de Pagos

Banco Central de Reserva del Perú

Enero de 2025



BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

# Derivados Cambiarios – Según Residencia de Contraparte

1. Objetivo de información requerida
2. Forma correcta de completar la tabla

# Derivados Cambiarios: Objetivo de Información Requerida

- La empresa debe reportar los saldos (valor nocional) que mantiene de instrumentos derivados para recibir o pagar US dólares a cambio de soles. Deberá consignar los valores en cada tipo de derivado según la residencia de su contraparte.
- Esta información (junto con aquella de la tabla Panorama B) permite evaluar el descalce cambiario de la empresa, su exposición patrimonial al riesgo cambiario, y el impacto de las variaciones cambiarias sobre sus resultados.

<b>Tabla IV.3 Derivados cambiarios según contraparte residente y no residente Posiciones para recibir y pagar moneda extranjera del trimestre actual</b>
Valor <b>nocional</b> de contratos en moneda extranjera y contratos vinculados a una moneda extranjera

( En miles de US dólares)

UNIDAD DECLARANTE: EMPRESAS NO FINANCIERAS RESIDENTES				
		POSICIONES PENDIENTES SALDO DE CIERRE DE TRIMESTRE ACTUAL		
		A	B	C
CÓDIGO	TIPO DE OPERACIÓN	Contraparte residente	Contraparte no residente	TOTAL
15 . .	I. Operaciones Netas según contraparte (1-2)	0	0	0
15 . .01 .	1. Para recibir moneda extranjera	0	0	0
15 . .01 .01 .	Futuros			0
15 . .01 .02 .	Forwards			0
15 . .01 .03 .	Swaps			0
15 . .01 .04 .	Opciones			0
15 . .01 .05 .	Otros			0
15 . .02 .	2. Para pagar moneda extranjera	0	0	0
15 . .02 .01 .	Futuros			0
15 . .02 .02 .	Forwards			0
15 . .02 .03 .	Swaps			0
15 . .02 .04 .	Opciones			0
15 . .02 .05 .	Otros			0

# Derivados Cambiarios: Forma Correcta de Completar la Tabla

## Instrucciones:

1. Contraparte residente: la empresa debe reportar los saldos nominales de cada tipo de derivado por el que recibiría dólares americanos a cambio de soles.
2. Contraparte no residente: la empresa debe reportar los saldos nominales de cada tipo de derivado por el que recibiría dólares americanos a cambio de soles.

( En miles de US dólares)

UNIDAD DECLARANTE: EMPRESAS NO FINANCIERAS RESIDENTES				
		POSICIONES PENDIENTES SALDO DE CIERRE DE TRIMESTRE ACTUAL		
		A	B	C
CÓDIGO	TIPO DE OPERACIÓN	Contraparte residente	Contraparte no residente	TOTAL
15 . .	I. Operaciones Netas según contraparte (1-2)	0	0	0
15 . . 01 .	1. Para recibir moneda extranjera	0	0	0
15 . . 01 . 01 .	Futuros			0
15 . . 01 . 02 .	Forwards			0
15 . . 01 . 03 .	Swaps			0
15 . . 01 . 04 .	Opciones			0
15 . . 01 . 05 .	Otros			0

- Ingresar valor nominal (en miles de US dólares) en cada tipo de derivados según residencia de contraparte.
- La tabla calculará los totales correspondientes.

# Derivados Cambiarios: Forma Correcta de Completar la Tabla

## Instrucciones:

1. Contraparte residente: la empresa debe reportar los saldos nocionales de cada tipo de derivado por el que pagaría dólares americanos a cambio de soles.
2. Contraparte no residente: la empresa debe reportar los saldos nocionales de cada tipo de derivado por el que pagaría dólares americanos a cambio de soles.

( En miles de US dólares)

UNIDAD DECLARANTE: EMPRESAS NO FINANCIERAS RESIDENTES				
		POSICIONES PENDIENTES SALDO DE CIERRE DE TRIMESTRE ACTUAL		
		A	B	C
CÓDIGO	TIPO DE OPERACIÓN	Contraparte residente	Contraparte no residente	TOTAL
15..02.	2. Para pagar moneda extranjera	0	0	0
15..02.01.	Futuros			0
15..02.02.	Forwards			0
15..02.03.	Swaps			0
15..02.04.	Opciones			0
15..02.05.	Otros			0

- Ingresar valor nocional (en miles de US dólares) en cada tipo de derivados según residencia de contraparte.
- La tabla calculará los totales correspondientes.

# Derivados Cambiarios – Según Residencia de Contraparte

Encuesta Trimestral de Balanza de Pagos

Banco Central de Reserva del Perú

Enero de 2025



BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

