

## **CIRCULAR No. 008-2001-EF/90**

Lima, 27 de marzo del 2001

### **Ref.: Modificaciones al reporte de la estadística diaria de compras y ventas de moneda extranjera**

Con la finalidad de mejorar la calidad de la información estadística de compras y ventas de moneda extranjera, remitida diariamente por las empresas bancarias, financieras y el Banco de la Nación, el Directorio de este Banco Central ha dispuesto modificar la estructura del reporte referido, dejando sin efecto la Circular No. 020-97-EF/90 y sustituyéndola por la presente que regirá a partir del 2 de mayo del 2001.

En esta oportunidad se desagrega la información de las operaciones a futuro entre tipos de *forwards* con entrega y sin entrega y *swaps*, y se descompone la Posición de Cambio en aquella asignada a compra/venta o de tesorería y a la cobertura del patrimonio y de las operaciones a futuro. Se sustituye el plazo de los *forwards* de 1 a 30 días por los rangos de 1 a 7 días y de 8 a 30 días y se incorpora como nuevo rubro el de operaciones internas.

Las entidades del sistema financiero deberán transmitir electrónicamente a la Gerencia de Crédito y Regulación Financiera de este Banco Central, vía el Sistema de Interconexión Bancaria (SIB), el Formato 070 y sus anexos 01, 02 y 03, así como, el Formato 080 con su Anexo 01 que se adjuntan a la presente circular, con información adelantada, de lunes a viernes hasta las 16:30 horas. Para el efecto, la Gerencia de Crédito y Regulación Financiera del Banco Central coordinará con cada institución el esquema de transmisión de la información.

En caso de no ser posible la transmisión por el SIB, la información deberá ser remitida, previa coordinación con la Gerencia de Crédito y Regulación Financiera, por alguno de los siguientes medios: *File Transfer Protocole (FTP)*, correo electrónico o al facsímil número 428-4492.

La confirmación o modificación de los datos adelantados se efectuará mediante el envío de los formatos y anexos correspondientes con información definitiva, por alguna de las vías indicadas, hasta las 10:00 horas del día útil siguiente.

Las divergencias entre la información adelantada y definitiva que superen los US\$ 5,0 millones, en cada uno de los distintos rubros del reporte, deberán ser explicadas en cada oportunidad mediante carta dirigida a la Gerencia de Crédito y Regulación Financiera de este Banco Central.

Con la finalidad de elaborar las series históricas de los saldos de la posición de cambio, las empresas bancarias, financieras y el Banco de la Nación deberán enviar la información definitiva correspondiente al cierre de abril del 2001, según el Anexo 03 del Formato 70. Dicha información deberá ser enviada al facsímil número 428-4492, a más tardar el 2 de mayo del 2001. Por esta única vez, deberán remitirse todos los saldos independientemente de que se trate de un **Dato** o **Resultado**.

Entre el 2 y el 18 de mayo del 2001, las entidades financieras deberán remitir su información tanto por el Sistema de Interconexión Bancaria (SIB) como por alguna de las vías alternativas previstas (*File Transfer Protocole – FTP*, correo electrónico o facsímil).

Quedan sin efecto la Carta Circular No.21-91-EF/90, la Carta Circular No.41-91-EF/90, la Carta Circular No.2-92-EF/90 y la Circular No. 23-99-EF/90.

**Javier de la Rocha Marie**  
**Gerente General**

**POSICIÓN DE CAMBIO****FORMATO 070 ANEXOS 01 Y 02****CABECERA Y NOMBRE DEL ARCHIVO**

<b>Longitud</b>	<b>Posición</b>		<b>Observaciones</b>
3	1	3	Código de institución que reporta
1	4	4	A=adelantado D=definitivo
4	5	8	Código de formato (0070)
2	9	10	Código de anexo (01 ó 02)
8	11	18	Fecha de reporte (AAAAMMDD)
1	19	19	U=unidades

**DATA**

<b>Longitud</b>	<b>Posición</b>		<b>Observaciones</b>
6	1	6	Código de operación - Según tabla de operaciones
3	7	9	Código de institución con la que se opera
12	10	21	Monto de operación (10 enteros 2 decimales)
1	22	22	Signo - No utilizar
7	23	29	Tipo de cambio (2 enteros 5 decimales) 1./
4	30	33	Plazo en días-Solo para operaciones <i>forwara</i> y <i>swap</i> pactados 2./

**FORMATO 070 - ANEXO 01**  
**REPORTE DE LA ESTADÍSTICA DIARIA DE COMPRAS DE MONEDA EXTRANJERA**

<u>código de operación</u>	<u>descripción</u>	<u>clase 3./</u>
100000	<b>Total de compras al público</b>	<b>Resultado</b>
110000	<b>Contado</b>	<b>Resultado</b>
111000	<i>Spot</i> Total	<b>Resultado</b>
111100	<i>Spot</i> 4./	Dato
111200	Operaciones Internas 5./	Dato
112000	<b>Operaciones a futuro vencidas 6./</b>	<b>Resultado</b>
112100	<b>Forwards vencidos</b>	<b>Resultado</b>
112110	<i>Forwards</i> vencidos con entrega	Dato
112120	<i>Forwards</i> vencidos sin entrega	Dato
112200	<i>Swaps</i> vencidos	Dato
112900	Otras operaciones a futuro vencidas	Dato
120000	<b>Operaciones a futuro pactadas 7./</b>	<b>Resultado</b>
121000	<b>Forwards pactados</b>	<b>Resultado</b>
121100	<b>Forwards pactados con entrega 8./</b>	<b>Resultado</b>
121110	<b>Forwards pactados de 1 a 30 días con entrega</b>	<b>Resultado</b>
121111	<i>Forwards</i> pactados de 1 a 7 días con entrega	Dato
121112	<i>Forwards</i> pactados de 8 a 30 días con entrega	Dato
121120	<i>Forwards</i> pactados de 31 a 90 días con entrega	Dato
121130	<i>Forwards</i> pactados de 91 a 360 días con entrega	Dato
121150	<i>Forwards</i> pactados a más de 360 días con entrega	Dato
121200	<b>Forwards pactados sin entrega 9./</b>	<b>Resultado</b>
121210	<b>Forwards pactados de 1 a 30 días sin entrega</b>	<b>Resultado</b>
121211	<i>Forwards</i> pactados de 1 a 7 días sin entrega	Dato
121212	<i>Forwards</i> pactados de 8 a 30 días sin entrega	Dato
121220	<i>Forwards</i> pactados de 31 a 90 días sin entrega	Dato
121230	<i>Forwards</i> pactados de 91 a 360 días sin entrega	Dato
121250	<i>Forwards</i> pactados a más de 360 días sin entrega	Dato
122000	<i>Swaps</i> pactados	Dato
129000	Otras operaciones a futuro pactadas	Dato
200000	<b>Total de compras a las entidades del sistema financiero</b>	<b>Resultado</b>
210000	<b>Contado</b>	<b>Resultado</b>
211000	<i>Spot</i> Total 4./	<b>Resultado</b>
211000001	Banco 001	Dato
211000002	Banco 002	Dato
211000003	Banco 003	Dato
211000nnn	Banco nnn	Dato
212000	<b>Operaciones a futuro vencidas 6./</b>	<b>Resultado</b>
212100	<b>Forwards vencidos</b>	<b>Resultado</b>
212110	<b>Forwards vencidos con entrega</b>	<b>Resultado</b>
212110001	Banco 001	Dato
212110002	Banco 002	Dato
212110003	Banco 003	Dato
212110nnn	Banco nnn	Dato
212120	<b>Forwards vencidos sin entrega</b>	<b>Resultado</b>
212120001	Banco 001	Dato
212120002	Banco 002	Dato
212120003	Banco 003	Dato
212120nnn	Banco nnn	Dato
212200	<b>Swaps vencidos</b>	<b>Resultado</b>
212200001	Banco 001	Dato
212200002	Banco 002	Dato
212200003	Banco 003	Dato
212200nnn	Banco nnn	Dato
212900	<b>Otras operaciones a futuro vencidas</b>	<b>Resultado</b>
212900001	Banco 001	Dato
212900002	Banco 002	Dato
212900003	Banco 003	Dato
212900nnn	Banco nnn	Dato
220000	<b>Operaciones a futuro pactadas 7./</b>	<b>Resultado</b>
220000001	Banco 001	<b>Resultado</b>
220000002	Banco 002	<b>Resultado</b>
220000003	Banco 003	<b>Resultado</b>
220000nnn	Banco nnn	<b>Resultado</b>
221000	<b>Forwards pactados</b>	<b>Resultado</b>
221100	<b>Forwards pactados con entrega 8./</b>	<b>Resultado</b>
221110	<b>Forwards pactados de 1 a 30 días con entrega</b>	<b>Resultado</b>
221111	<b>Forwards pactados de 1 a 7 días con entrega</b>	<b>Resultado</b>
221111001	Banco 001	Dato
221111002	Banco 002	Dato
221111003	Banco 003	Dato
221111nnn	Banco nnn	Dato
221112	<b>Forwards pactados de 8 a 30 días con entrega</b>	<b>Resultado</b>

**FORMATO 070 - ANEXO 01**  
**REPORTE DE LA ESTADÍSTICA DIARIA DE COMPRAS DE MONEDA EXTRANJERA**

<u>código de operación</u>	<u>descripción</u>	<u>clase 3./</u>
221112001	Banco 001	Dato
221112002	Banco 002	Dato
221112003	Banco 003	Dato
221112nnn	Banco nnn	Dato
221120	<b>Forwards pactados de 31 a 90 días con entrega</b>	<b>Resultado</b>
221120001	Banco 001	Dato
221120002	Banco 002	Dato
221120003	Banco 003	Dato
221120nnn	Banco nnn	Dato
221130	<b>Forwards pactados de 91 a 360 días con entrega</b>	<b>Resultado</b>
221130001	Banco 001	Dato
221130002	Banco 002	Dato
221130003	Banco 003	Dato
221130nnn	Banco nnn	Dato
221150	<b>Forwards pactados a más de 360 días con entrega</b>	<b>Resultado</b>
221150001	Banco 001	Dato
221150002	Banco 002	Dato
221150003	Banco 003	Dato
221150nnn	Banco nnn	Dato
221200	<b>Forwards pactados sin entrega 9./</b>	<b>Resultado</b>
221210	<b>Forwards pactados de 1 a 30 días sin entrega</b>	<b>Resultado</b>
221211	<b>Forwards pactados de 1 a 7 días sin entrega</b>	<b>Resultado</b>
221211001	Banco 001	Dato
221211002	Banco 002	Dato
221211003	Banco 003	Dato
221211nnn	Banco nnn	Dato
221212	<b>Forwards pactados de 8 a 30 días sin entrega</b>	<b>Resultado</b>
221212001	Banco 001	Dato
221212002	Banco 002	Dato
221212003	Banco 003	Dato
221212nnn	Banco nnn	Dato
221220	<b>Forwards pactados de 31 a 90 días sin entrega</b>	<b>Resultado</b>
221220001	Banco 001	Dato
221220002	Banco 002	Dato
221220003	Banco 003	Dato
221220nnn	Banco nnn	Dato
221230	<b>Forwards pactados de 91 a 360 días sin entrega</b>	<b>Resultado</b>
221230001	Banco 001	Dato
221230002	Banco 002	Dato
221230003	Banco 003	Dato
221230nnn	Banco nnn	Dato
221250	<b>Forwards pactados a más de 360 días sin entrega</b>	<b>Resultado</b>
221250001	Banco 001	Dato
221250002	Banco 002	Dato
221250003	Banco 003	Dato
221250nnn	Banco nnn	Dato
222000	<b>Swaps pactados</b>	<b>Resultado</b>
222000001	Banco 001	Dato
222000002	Banco 002	Dato
222000003	Banco 003	Dato
222000nnn	Banco nnn	Dato
229000	<b>Otras operaciones a futuro pactadas</b>	<b>Resultado</b>
229000001	Banco 001	Dato
229000002	Banco 002	Dato
229000003	Banco 003	Dato
229000nnn	Banco nnn	Dato
300000	<b>Total de compras al BCRP</b>	<b>Resultado</b>
310000	<b>Contado</b>	<b>Resultado</b>
311000	<i>Spot</i> Total 4./	Dato
312000	<b>Operaciones a futuro vencidas 6./</b>	<b>Resultado</b>
312100	<b>Forwards vencidos</b>	<b>Resultado</b>
312110	<i>Forwards</i> vencidos con entrega	Dato
312120	<i>Forwards</i> vencidos sin entrega	Dato
312200	<i>Swaps</i> vencidos	Dato
312900	Otras operaciones a futuro vencidas	Dato
320000	<b>Operaciones a futuro pactadas 7./</b>	<b>Resultado</b>
321000	<b>Forwards pactados</b>	<b>Resultado</b>
321100	<b>Forwards pactados con entrega 8./</b>	<b>Resultado</b>
321110	<b>Forwards pactados de 1 a 30 días con entrega</b>	<b>Resultado</b>
321111	<i>Forwards</i> pactados de 1 a 7 días con entrega	Dato
321112	<i>Forwards</i> pactados de 8 a 30 días con entrega	Dato
321120	<i>Forwards</i> pactados de 31 a 90 días con entrega	Dato

**FORMATO 070 - ANEXO 01**  
**REPORTE DE LA ESTADÍSTICA DIARIA DE COMPRAS DE MONEDA EXTRANJERA**

<u>código de operación</u>	<u>descripción</u>	<u>clase 3./</u>
321130	<i>Forwards</i> pactados de 91 a 360 días con entrega	Dato
321150	<i>Forwards</i> pactados a más de 360 días con entrega	Dato
321200	<b>Forwards pactados sin entrega 9./</b>	<b>Resultado</b>
321210	<b>Forwards pactados de 1 a 30 días sin entrega</b>	<b>Resultado</b>
321211	<i>Forwards</i> pactados de 1 a 7 días sin entrega	Dato
321212	<i>Forwards</i> pactados de 8 a 30 días sin entrega	Dato
321220	<i>Forwards</i> pactados de 31 a 90 días sin entrega	Dato
321230	<i>Forwards</i> pactados de 91 a 360 días sin entrega	Dato
321250	<i>Forwards</i> pactados a más de 360 días sin entrega	Dato
322000	<i>Swaps</i> pactados	Dato
329000	Otras operaciones a futuro pactadas	Dato
400000	<b>TOTAL DE COMPRAS</b>	Dato y Resultado

**FORMATO 070 - ANEXO 02**  
**REPORTE DE LA ESTADÍSTICA DIARIA DE VENTAS DE MONEDA EXTRANJERA**

<u>código de operación</u>	<u>descripción</u>	<u>clase 3./</u>
100000	<b>Total de ventas al público</b>	<b>Resultado</b>
110000	<b>Contado</b>	<b>Resultado</b>
111000	<i>Spot</i> Total	<b>Resultado</b>
111100	<i>Spot</i> 4./	Dato
111200	Operaciones Internas 5./	Dato
112000	<b>Operaciones a futuro vencidas 6./</b>	<b>Resultado</b>
112100	<b>Forwards vencidos</b>	<b>Resultado</b>
112110	<i>Forwards</i> vencidos con entrega	Dato
112120	<i>Forwards</i> vencidos sin entrega	Dato
112200	<i>Swaps</i> vencidos	Dato
112900	Otras operaciones a futuro vencidas	Dato
120000	<b>Operaciones a futuro pactadas 7./</b>	<b>Resultado</b>
121000	<b>Forwards pactados</b>	<b>Resultado</b>
121100	<b>Forwards pactados con entrega 8./</b>	<b>Resultado</b>
121110	<b>Forwards pactados de 1 a 30 días con entrega</b>	<b>Resultado</b>
121111	<i>Forwards</i> pactados de 1 a 7 días con entrega	Dato
121112	<i>Forwards</i> pactados de 8 a 30 días con entrega	Dato
121120	<i>Forwards</i> pactados de 31 a 90 días con entrega	Dato
121130	<i>Forwards</i> pactados de 91 a 360 días con entrega	Dato
121150	<i>Forwards</i> pactados a más de 360 días con entrega	Dato
121200	<b>Forwards pactados sin entrega 9./</b>	<b>Resultado</b>
121210	<b>Forwards pactados de 1 a 30 días sin entrega</b>	<b>Resultado</b>
121211	<i>Forwards</i> pactados de 1 a 7 días sin entrega	Dato
121212	<i>Forwards</i> pactados de 8 a 30 días sin entrega	Dato
121220	<i>Forwards</i> pactados de 31 a 90 días sin entrega	Dato
121230	<i>Forwards</i> pactados de 91 a 360 días sin entrega	Dato
121250	<i>Forwards</i> pactados a más de 360 días sin entrega	Dato
122000	<i>Swaps</i> pactados	Dato
129000	Otras operaciones a futuro pactadas	Dato
200000	<b>Total de ventas a las entidades del sistema financiero</b>	<b>Resultado</b>
210000	<b>Contado</b>	<b>Resultado</b>
211000	<i>Spot</i> Total 4./	<b>Resultado</b>
211000001	Banco 001	Dato
211000002	Banco 002	Dato
211000003	Banco 003	Dato
211000nnn	Banco nnn	Dato
212000	<b>Operaciones a futuro vencidas 6./</b>	<b>Resultado</b>
212100	<b>Forwards vencidos</b>	<b>Resultado</b>
212110	<b>Forwards vencidos con entrega</b>	<b>Resultado</b>
212110001	Banco 001	Dato
212110002	Banco 002	Dato
212110003	Banco 003	Dato
212110nnn	Banco nnn	Dato
212120	<b>Forwards vencidos sin entrega</b>	<b>Resultado</b>
212120001	Banco 001	Dato
212120002	Banco 002	Dato
212120003	Banco 003	Dato
212120nnn	Banco nnn	Dato
212200	<b>Swaps vencidos</b>	<b>Resultado</b>
212200001	Banco 001	Dato
212200002	Banco 002	Dato
212200003	Banco 003	Dato
212200nnn	Banco nnn	Dato
212900	<b>Otras operaciones a futuro vencidas</b>	<b>Resultado</b>
212900001	Banco 001	Dato
212900002	Banco 002	Dato
212900003	Banco 003	Dato
212900nnn	Banco nnn	Dato
220000	<b>Operaciones a futuro pactadas 7./</b>	<b>Resultado</b>
220000001	Banco 001	<b>Resultado</b>
220000002	Banco 002	<b>Resultado</b>
220000003	Banco 003	<b>Resultado</b>
220000nnn	Banco nnn	<b>Resultado</b>
221000	<b>Forwards pactados</b>	<b>Resultado</b>
221100	<b>Forwards pactados con entrega 8./</b>	<b>Resultado</b>
221110	<b>Forwards pactados de 1 a 30 días con entrega</b>	<b>Resultado</b>
221111	<b>Forwards pactados de 1 a 7 días con entrega</b>	<b>Resultado</b>
221111001	Banco 001	Dato
221111002	Banco 002	Dato
221111003	Banco 003	Dato
221111nnn	Banco nnn	Dato
221112	<b>Forwards pactados de 8 a 30 días con entrega</b>	<b>Resultado</b>
221112001	Banco 001	Dato
221112002	Banco 002	Dato
221112003	Banco 003	Dato

**FORMATO 070 - ANEXO 02**  
**REPORTE DE LA ESTADÍSTICA DIARIA DE VENTAS DE MONEDA EXTRANJERA**

<u>código de operación</u>	<u>descripción</u>	<u>clase 3./</u>
221112nnn	Banco nnn	Dato
221120	<b>Forwards</b> pactados de 31 a 90 días con entrega	<b>Resultado</b>
221120001	Banco 001	Dato
221120002	Banco 002	Dato
221120003	Banco 003	Dato
221120nnn	Banco nnn	Dato
221130	<b>Forwards</b> pactados de 91 a 360 días con entrega	<b>Resultado</b>
221130001	Banco 001	Dato
221130002	Banco 002	Dato
221130003	Banco 003	Dato
221130nnn	Banco nnn	Dato
221150	<b>Forwards</b> pactados a más de 360 días con entrega	<b>Resultado</b>
221150001	Banco 001	Dato
221150002	Banco 002	Dato
221150003	Banco 003	Dato
221150nnn	Banco nnn	Dato
221200	<b>Forwards</b> pactados sin entrega 9./	<b>Resultado</b>
221210	<b>Forwards</b> pactados de 1 a 30 días sin entrega	<b>Resultado</b>
221211	<b>Forwards</b> pactados de 1 a 7 días sin entrega	<b>Resultado</b>
221211001	Banco 001	Dato
221211002	Banco 002	Dato
221211003	Banco 003	Dato
221211nnn	Banco nnn	Dato
221212	<b>Forwards</b> pactados de 8 a 30 días sin entrega	<b>Resultado</b>
221212001	Banco 001	Dato
221212002	Banco 002	Dato
221212003	Banco 003	Dato
221212nnn	Banco nnn	Dato
221220	<b>Forwards</b> pactados de 31 a 90 días sin entrega	<b>Resultado</b>
221220001	Banco 001	Dato
221220002	Banco 002	Dato
221220003	Banco 003	Dato
221220nnn	Banco nnn	Dato
221230	<b>Forwards</b> pactados de 91 a 360 días sin entrega	<b>Resultado</b>
221230001	Banco 001	Dato
221230002	Banco 002	Dato
221230003	Banco 003	Dato
221230nnn	Banco nnn	Dato
221250	<b>Forwards</b> pactados a más de 360 días sin entrega	<b>Resultado</b>
221250001	Banco 001	Dato
221250002	Banco 002	Dato
221250003	Banco 003	Dato
221250nnn	Banco nnn	Dato
222000	<b>Swaps</b> pactados	<b>Resultado</b>
222000001	Banco 001	Dato
222000002	Banco 002	Dato
222000003	Banco 003	Dato
222000nnn	Banco nnn	Dato
229000	<b>Otras operaciones a futuro</b> pactadas	<b>Resultado</b>
229000001	Banco 001	Dato
229000002	Banco 002	Dato
229000003	Banco 003	Dato
229000nnn	Banco nnn	Dato
300000	<b>Total de ventas al BCRP</b>	<b>Resultado</b>
310000	<b>Contado</b>	<b>Resultado</b>
311000	<i>Spot</i> Total 4./	Dato
312000	<b>Operaciones a futuro</b> vencidas 6./	<b>Resultado</b>
312100	<b>Forwards</b> vencidos	<b>Resultado</b>
312110	<i>Forwards</i> vencidos con entrega	Dato
312120	<i>Forwards</i> vencidos sin entrega	Dato
312200	<i>Swaps</i> vencidos	Dato
312900	Otras operaciones a futuro vencidas	Dato
320000	<b>Operaciones a futuro</b> pactadas 7./	<b>Resultado</b>
321000	<b>Forwards</b> pactados	<b>Resultado</b>
321100	<b>Forwards</b> pactados con entrega 8./	<b>Resultado</b>
321110	<b>Forwards</b> pactados de 1 a 30 días con entrega	<b>Resultado</b>
321111	<i>Forwards</i> pactados de 1 a 7 días con entrega	Dato
321112	<i>Forwards</i> pactados de 8 a 30 días con entrega	Dato
321120	<i>Forwards</i> pactados de 31 a 90 días con entrega	Dato
321130	<i>Forwards</i> pactados de 91 a 360 días con entrega	Dato
321150	<i>Forwards</i> pactados a más de 360 días con entrega	Dato
321200	<b>Forwards</b> pactados sin entrega 9./	<b>Resultado</b>
321210	<b>Forwards</b> pactados de 1 a 30 días sin entrega	<b>Resultado</b>
321211	<i>Forwards</i> pactados de 1 a 7 días sin entrega	Dato
321212	<i>Forwards</i> pactados de 8 a 30 días sin entrega	Dato

**FORMATO 070 - ANEXO 02**  
**REPORTE DE LA ESTADÍSTICA DIARIA DE VENTAS DE MONEDA EXTRANJERA**

<u>código de operación</u>	<u>descripción</u>	<u>clase 3./</u>
321220	<i>Forwards</i> pactados de 31 a 90 días sin entrega	Dato
321230	<i>Forwards</i> pactados de 91 a 360 días sin entrega	Dato
321250	<i>Forwards</i> pactados a más de 360 días sin entrega	Dato
322000	<i>Swaps</i> pactados	Dato
329000	Otras operaciones a futuro pactadas	Dato
400000	<b>TOTAL DE VENTAS</b>	Dato y Resultado



# POSICIÓN DE CAMBIO FORMATO 070 ANEXO 03

## CABECERA Y NOMBRE DEL ARCHIVO

Longitud	Posición		Observaciones
3	1	3	Código de institución que reporta
1	4	4	A=adelantado D=definitivo
4	5	8	Código de formato (0070)
2	9	10	Código de anexo (03)
8	11	18	Fecha de reporte (AAAAMMDD)
1	19	19	U=unidades

## DATA

Longitud	Posición		Observaciones
6	1	6	Código de operación - Según tabla de operaciones
12	7	18	Monto de operación (10 enteros 2 decimales)
1	19	19	Signo - No utilizar

**FORMATO 070 - ANEXO 03**  
**REPORTE DE LA ESTADÍSTICA DIARIA DE COMPRAS Y VENTAS DE MONEDA EXTRANJERA**

<u>código de operación</u>	<u>descripción</u>	<u>clase 3./</u>
130000	A. Saldo de sobrecompra o sobreventa al día anterior	Dato y resultado
140000	<b>B. Sobrecompra o sobreventa del día 10./</b>	<b>Resultado</b>
150000	C. Saldo de sobrecompra o sobreventa al cierre (A+B) 11./	Dato y resultado
160000	D. Saldo de compras a futuro al cierre 12./	Dato y resultado
170000	E. Saldo de ventas a futuro al cierre 12./	Dato y resultado
180000	<b>F. Saldo al cierre de forwards de compra por vencer (G+J)</b>	<b>Resultado</b>
190000	<b>G. Pactados con el público (H+I)</b>	<b>Resultado</b>
200000	<b>H. Con entrega</b>	<b>Resultado</b>
210000	<b>I. Sin entrega</b>	<b>Resultado</b>
220000	<b>J. Pactadas con las empresas del sistema financiero (K+L)</b>	<b>Resultado</b>
230000	<b>K. Con entrega</b>	<b>Resultado</b>
240000	<b>L. Sin entrega</b>	<b>Resultado</b>
250000	<b>M. Saldo al cierre de forwards de venta por vencer (N+Q)</b>	<b>Resultado</b>
260000	<b>N. Pactados con el público (O+P)</b>	<b>Resultado</b>
270000	<b>O. Con entrega</b>	<b>Resultado</b>
280000	<b>P. Sin entrega</b>	<b>Resultado</b>
290000	<b>Q. Pactados con las empresas del sistema financiero (R+S)</b>	<b>Resultado</b>
300000	<b>R. Con entrega</b>	<b>Resultado</b>
310000	<b>S. Sin entrega</b>	<b>Resultado</b>
	<b>COMPOSICIÓN DE LA POSICIÓN DE CAMBIOS</b>	<b>Título</b>
320000	<b>T. Posición estructural o de cobertura patrimonial 13./</b>	<b>Resultado</b>
321000	En dólares de EE.UU.	Dato
322000	En otras monedas 14./	Dato
330000	<b>U. Posición de cobertura de operaciones a futuro 15./</b>	<b>Resultado</b>
331000	En dólares de EE.UU.	Dato
332000	En otras monedas 14./	Dato
340000	<b>V. Posición de compra/venta o de tesorería 16./</b>	<b>Resultado</b>
341000	En dólares de EE.UU.	Dato
342000	En otras monedas 14./	Dato
350000	<b>W. Otras modalidades</b>	<b>Resultado</b>
351000	En dólares de EE.UU.	Dato
352000	En otras monedas 14./	Dato
360000	<b>Posición de Cambio de Balance = T+U+V+W = C (al año/mes/día) 17./</b>	<b>Resultado</b>
370000	<b>Posición de Cambios Global = C+D-E (al año/mes/día) 18./</b>	<b>Resultado</b>

## **FORMATO 070 - ANEXOS 01, 02 Y 03**

### **REPORTE DE LA ESTADÍSTICA DIARIA DE COMPRAS Y VENTAS DE MONEDA EXTRANJERA**

#### **NOTAS METODOLÓGICAS**

1. Tipo de cambio promedio, ponderado por monto, con cinco decimales. En el caso de *forwards*, los promedios comprenden a todas las operaciones con vencimientos dentro del rango señalado. En el caso de otras operaciones a futuro pactadas y vencidas no es necesario poner este dato.
2. Indicar el plazo promedio ponderado por monto. En el caso de *forwards* pactados el promedio está referido a las operaciones realizadas dentro del rango señalado. El plazo se define como el número de días comprendido entre las fechas de inicio y cierre de cada operación.
3. Solo se debe reportar información cuando la clase sea Dato o Dato y resultado.
4. En el caso de efectuarse un *swap*, en este rubro debe incluirse la porción *spot* correspondiente.
5. Comprende todas aquellas operaciones que afectan la posición de cambio y que no han sido efectuadas directamente con alguna de las contrapartes indicadas: público, entidades del sistema financiero y Banco Central de Reserva. En este rubro se debe registrar operaciones en moneda extranjera como provisiones, devengamiento de intereses y aportes de capital, entre otras.
6. Comprende todas las operaciones a futuro que vencen en el día.
7. Comprende todas las operaciones a futuro pactadas en el día, a un plazo mayor o igual a 1 día.
8. *Forwards* de moneda extranjera, en los que al vencimiento se producirá el intercambio efectivo de las monedas pactadas.
9. *Forwards* de moneda extranjera en los que al vencimiento no se producirá el intercambio efectivo de las monedas pactadas, sino sólo de la utilidad o pérdida generada por la diferencia cambiaria entre el tipo de cambio *forward* al que se pactó la operación y el tipo de cambio *spot* del día de vencimiento.
10. Flujo de compras menos ventas registradas en el rubro contado para el día del reporte. Debe incluir todas las operaciones que afecten la Posición de Cambio de Balance.
11. Saldo del día que incluye sólo las operaciones registradas en el rubro contado, es decir, *spot* más operaciones a futuro vencidas a la fecha. Dicha posición corresponde a la Posición de Cambio de Balance reportada diariamente en el Anexo N° 15-A Reporte de Tesorería y Posición Diaria de Liquidez aprobado por la Resolución SBS N° 0744-99.
12. Saldo del día que incluye *forwards*, *swaps* y otras operaciones a futuro por vencer.
13. Se refiere a la porción de la Posición de Cambios de Balance asignada a cubrir el patrimonio de la empresa frente a variaciones en el tipo de cambio.
14. Expresado en dólares de los EE.UU. al tipo de cambio de cierre de operaciones del mercado de cambios de Nueva York del día anterior, de acuerdo con lo reportado por la Agencia REUTERS.
15. Se refiere a la porción de la Posición de Cambios de Balance utilizada para respaldar las operaciones a futuro.
16. Se refiere a la porción de la Posición de Cambios de Balance asignada para la realización de operaciones *spot* en el mercado de divisas, con la intención de generar beneficios por variaciones en el tipo de cambio.
17. Debe ser igual al literal C de este reporte.
18. Debe ser igual a los literales C+D-E. Dicha posición corresponde a la Posición de Cambio Global reportada diariamente en el Anexo N° 15 – A Reporte de Tesorería y Posición Diaria de Liquidez aprobado por la Resolución SBS N° 0744-99.

## **FORMATO 070 - ANEXOS 01, 02 Y 03**

### **REPORTE DE LA ESTADÍSTICA DIARIA DE COMPRAS Y VENTAS DE MONEDA EXTRANJERA**

#### **NOTAS METODOLÓGICAS**

1. Tipo de cambio promedio, ponderado por monto, con cinco decimales. En el caso de *forwards*, los promedios comprenden a todas las operaciones con vencimientos dentro del rango señalado. En el caso de otras operaciones a futuro pactadas y vencidas no es necesario poner este dato.
2. Indicar el plazo promedio ponderado por monto. En el caso de *forwards* pactados el promedio está referido a las operaciones realizadas dentro del rango señalado. El plazo se define como el número de días comprendido entre las fechas de inicio y cierre de cada operación.
3. Solo se debe reportar información cuando la clase sea Dato o Dato y resultado.
4. En el caso de efectuarse un *swap*, en este rubro debe incluirse la porción *spot* correspondiente.
5. Comprende todas aquellas operaciones que afectan la posición de cambio y que no han sido efectuadas directamente con alguna de las contrapartes indicadas: público, entidades del sistema financiero y Banco Central de Reserva. En este rubro se debe registrar operaciones en moneda extranjera como provisiones, devengamiento de intereses y aportes de capital, entre otras.
6. Comprende todas las operaciones a futuro que vencen en el día.
7. Comprende todas las operaciones a futuro pactadas en el día, a un plazo mayor o igual a 1 día.
8. *Forwards* de moneda extranjera, en los que al vencimiento se producirá el intercambio efectivo de las monedas pactadas.
9. *Forwards* de moneda extranjera en los que al vencimiento no se producirá el intercambio efectivo de las monedas pactadas, sino sólo de la utilidad o pérdida generada por la diferencia cambiaria entre el tipo de cambio *forward* al que se pactó la operación y el tipo de cambio *spot* del día de vencimiento.
10. Flujo de compras menos ventas registradas en el rubro contado para el día del reporte. Debe incluir todas las operaciones que afecten la Posición de Cambio de Balance.
11. Saldo del día que incluye sólo las operaciones registradas en el rubro contado, es decir, *spot* más operaciones a futuro vencidas a la fecha. Dicha posición corresponde a la Posición de Cambio de Balance reportada diariamente en el Anexo N° 15-A Reporte de Tesorería y Posición Diaria de Liquidez aprobado por la Resolución SBS N° 0744-99.
12. Saldo del día que incluye *forwards*, *swaps* y otras operaciones a futuro por vencer.
13. Se refiere a la porción de la Posición de Cambios de Balance asignada a cubrir el patrimonio de la empresa frente a variaciones en el tipo de cambio.
14. Expresado en dólares de los EE.UU. al tipo de cambio de cierre de operaciones del mercado de cambios de Nueva York del día anterior, de acuerdo con lo reportado por la Agencia REUTERS.
15. Se refiere a la porción de la Posición de Cambios de Balance utilizada para respaldar las operaciones a futuro.
16. Se refiere a la porción de la Posición de Cambios de Balance asignada para la realización de operaciones *spot* en el mercado de divisas, con la intención de generar beneficios por variaciones en el tipo de cambio.
17. Debe ser igual al literal C de este reporte.
18. Debe ser igual a los literales C+D-E. Dicha posición corresponde a la Posición de Cambio Global reportada diariamente en el Anexo N° 15 – A Reporte de Tesorería y Posición Diaria de Liquidez aprobado por la Resolución SBS N° 0744-99.

# POSICIÓN DE CAMBIO FORMATO 080 ANEXO 01

## CABECERA Y NOMBRE DEL ARCHIVO

Longitud	Posición		Observaciones
3	1	3	Código de institución que reporta
1	4	4	A=adelantado D=definitivo
4	5	8	Código de formato (0080)
2	9	10	Código de anexo (01)
8	11	18	Fecha de reporte (AAAAMMDD)
1	19	19	U=unidades

## DATA

Longitud	Posición		Observaciones
6	1	6	Código de operación - Según anexo 01 1./
2	7	8	Tipo de operación - <b>01</b> =Compra <b>02</b> =Venta 2./
4	9	12	Código de país - Según tabla de países
11	13	23	Código de cliente. 3./
30	24	53	Nombre o razón social del cliente. 3./
3	54	56	Código de actividad - Según tabla de actividades
12	57	68	Monto de operación (10 enteros 2 decimales)
1	69	69	Signo - No utilizar
7	70	76	Tipo de cambio <i>Spot</i> (2 enteros 5 decimales) - Sólo para operaciones <i>spot</i> y <i>swap</i>
3	77	79	Plazo en días - Sólo para operaciones <i>forward</i> y <i>swap</i>
5	80	84	Tasa de interés MN (2 enteros 3 decimales) - Sólo para operaciones <i>forward</i> y <i>swap</i> 4./
5	85	89	Tasa de interés ME (2 enteros 3 decimales) - Sólo para operaciones <i>forward</i> y <i>swap</i> 4./
7	90	96	Tipo de cambio pactado (2 enteros 5 decimales) - Sólo para operaciones <i>forward</i> y <i>swap</i>
1	97	97	Forma de pago <b>D</b> = <i>delivery</i> <b>N</b> = <i>non delivery</i>
1	98	98	Vinculación <b>S</b> =sí <b>N</b> =no 5./

## NOTAS METODOLÓGICAS:

- 1./ Se reportan individualmente las operaciones *spot* por montos mayores o iguales a US\$ 1,0 millón y los *forwards* o *swaps* por montos mayores o iguales a US\$ 500 mil.
- 2./ Desde el punto de vista de la entidad financiera.
- 3./ Dejar en blanco. El Banco Central se reserva el derecho de solicitar esta información, manteniendo estricta confidencialidad sobre la misma.
- 4./ Tasas de interés efectivas anuales utilizadas al fijar precio.
- 5./ Se debe indicar si existe vinculación con el cliente en los términos definidos por la Superintendencia de Banca y Seguros (Resolución SBS N° 445-2000 del 06-07-2000).

**FORMATO 080 - ANEXO 01**  
**REPORTE DE LAS PRINCIPALES OPERACIONES CAMBIARIAS CON EL PÚBLICO**

<b><u>código de operación</u></b>	<b><u>descripción</u></b>	<b><u>clase</u></b>
100000	Operaciones <i>spot</i>	Dato
200000	Operaciones <i>forward</i>	Dato
300000	Operaciones <i>swap</i>	Dato