Fecha: [●]

Para : [●]

Atención : [●]

Dirección : [●]

Dirección de correo electrónico : [●]

Facsímile : [●]

De : Banco Central de Reserva del Perú

Atención : Departamento de Liquidación y Control de Operaciones Internas

Dirección : Jirón Miro Quesada 441-445, Cercado, Lima

Dirección de correo electrónico : Dpto.RegistroLiqConOpeInt@bcrp.gob.pe

Facsímile : (511) 613-2517

**RE: TRANSACCIÓN DE SWAP DE TASAS DE INTERËS**

Número de referencia de la transacción: [**Número de subasta u operación directa**]

El objeto de la presente carta convenio es confirmar los términos y condiciones de la Operación celebrada entre las partes arriba indicadas (las “Partes”) en la Fecha de Transacción mencionada más adelante. La presente carta constituye una “Confirmación” tal como este término se define en el Contrato Marco para Operaciones con Derivados especificado a continuación.

1. La Operación a la que se refiere la presente Confirmación está definida en la Circular de Swaps de Tasas de Interés del Banco Central de Reserva del Perú (Circular), aprobada por el BCR y vigente en la Fecha de Transacción.
2. La presente Confirmación complementa las definiciones comprendidas en la Circular. Asimismo, amplía, forma parte integral y se encuentra sujeta al Contrato Marco para Operaciones con Derivados y su Anexo de fecha [**FECHA**] y sus modificatorias y ampliatorias periódicas, suscrito entre el Banco Central de Reserva del Perú, en calidad de Parte A, y [●], en calidad de Parte B (el “Contrato Marco”). La presente Confirmación se regirá por las disposiciones del Contrato Marco, salvo las modificaciones expresas establecidas más adelante.
3. Los términos en mayúscula que no se encuentran definidos en la presente Confirmación tendrán el significado que se les atribuye en el Contrato Marco. En caso de discrepancia entre las definiciones contenidas en el Contrato Marco y aquéllas descritas en la presente Confirmación, primarán las últimas.
4. Los términos de la Operación específica a la que se relaciona la presente Confirmación, son los siguientes:

|  |
| --- |
| **Términos y condiciones generales** |
|  |  |  |
| Fecha de Transacción | : | [●] |
|  |  |  |
| Fecha de Inicio | : | [●] |
|  |  |  |
| Fecha de Vencimiento | : | [●] |
|  |  |
| Modalidad | : Expansión de Crédito; No Aplica |
|  |  |
| Agente de Cálculo | : | Parte A |
|  |  |  |
| PEN Nocional | : | PEN [●]Corresponde a la suma del nocional de las propuestas asignadas según se detalla en el Anexo |
|  |  |  |
| **Interés Variable:** |  |  |
|  |  |  |
| Pagador Tasa Variable | : | Parte A |
|  |  |  |
| Monto Nocional | : | PEN Nocional |
|  |  |  |
| Fecha de Pago de la Tasa Variable | : | Cada Fecha de Fin de Período de la Tasa Variable, con el Ajuste del Día Hábil Siguiente Modificado. |
|  |  |  |
| Fechas de Fin de Período de la Tasa Variable | : | [•], [•], [•], y [•] de cada año, comenzando el [•] hasta e incluyendo la Fecha de Término. |
|  |  |  |
| Ajuste del Día Hábil Siguiente Modificado | : | Será el Día Hábil siguiente |
|  |  |  |
| Periodo de Cálculo de la Tasa Variable | : | Cada período de cálculo va desde la última Fecha de Fin de Período de la Tasa Variable incluyéndola, hasta la siguiente Fecha Fin de Período de la Tasa Variable sin incluirla; a excepción de: (i) el primer Periodo de Cálculo de la Tasa Variable, el cual comenzará en la Fecha de Inicio, incluyéndola; y (ii) el último Periodo de Cálculo de la Tasa Variable, el cual terminará en la Fecha de Término, excluyéndola. |
|  |  |  |
| Cálculo de la Tasa Variable | : | La Tasa Variable será determinada por el Agente de Cálculo de acuerdo con la siguiente fórmula:$$\frac{ION\_{T-1}}{ION\_{t-1}}-1$$Donde*IONt-1 =* Índice Interbancario *Overnight* de un día calendario anterior al fin del último Periodo de Cálculo de la Tasa Variable*IONT-1* = Índice Interbancario *Overnight* de un día calendario anterior al fin del Periodo de Cálculo de la Tasa Variable correspondienteEl resultado será redondeado a seis decimales. |
|  |  |  |
| Tasa Variable | : | Para cualquier día calendario, el Índice Interbancario *Overnight* es publicado por el BCR en su portal institucional:<http://www.bcrp.gob.pe/estadisticas/indice-de-tasa-interbancaria-en-moneda-nacional.html>En ausencia de dicho índice, la Tasa Variable deberá ser determinada por el Agente de Cálculo. |
|  |  |  |
| Monto Variable | : | El Monto Variable será determinado por el Agente de Cálculo de la siguiente manera:$$N×\left[\frac{ION\_{T-1}}{ION\_{t-1}}-1\right]$$Donde$N$ = PEN Nocional |
|  |  |  |
| Días Hábiles para determinar el Índice Acumulado | :  | Lima |
|  |  |  |
| Días Hábiles para la Tasa Variable  | :  | Lima |
|  |  |  |
| **Interés Fijo** |  |  |
|  |  |  |
| Pagador Tasa Fija | : | Parte B |
|  |  |  |
| Monto Nocional  | : | PEN Nocional |
|  |  |  |
| Fecha de Pago de la Tasa Fija | : | Cada Fecha de Fin de Período de la Tasa Fija, con el Ajuste del Día Hábil Siguiente Modificado. |
|  |  |  |
| Fechas de Fin de Período de la Tasa Fija | : | [•], [•], [•], y [•] de cada año, comenzando el [•] hasta e incluyendo la Fecha de Término. |
|  |  |  |
| Ajuste del Día Hábil Siguiente Modificado | : | Será el Día Hábil siguiente |
|  |  |  |
| Periodo de Cálculo de la Tasa Fija  | : | Cada período de cálculo va desde la última Fecha de Fin de Período de la Tasa Fija incluyéndola, hasta la siguiente Fecha Fin de Período de la Tasa Fija sin incluirla; a excepción de: (i) el primer Periodo de Cálculo de la Tasa Fija, el cual comenzará en la Fecha de Inicio, incluyéndola; y (ii) el último Periodo de Cálculo de la Tasa Fija, el cual terminará en la Fecha de Término, excluyéndola. |
|  |  |  |
| Tasa Fija | : | La correspondiente a cada propuesta asignada en la transacción según se detalla en el Anexo |
|  |  |  |
| Monto Fijo | : | Suma de los intereses de todas las propuestas asignadas en la transacción. Para cada propuesta asignada, los intereses se calculan de la siguiente manera:$$N\_{i}×r\_{i}×^{d}/\_{360}$$ Donde$N\_{i}$ *=* Nocional en PEN de la propuesta i-ésima$r\_{i}$ = Tasa Fija de la propuesta i-ésima*d =* Periodo de Cálculo de la Tasa FijaEl Anexo contiene el detalle de las propuestas asignadas. |
|  |  |  |
| Base cálculo de intereses de la Tasa Fija | : | Actual/360 |
|  |  |  |
| Días Hábiles para la Tasa Fija  | :  | Lima |
|  |  |  |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Intercambio inicial de nocionales** | :  | Ninguno |
|  |  |  |
| **Intercambio intermedio de nocionales** | : | Ninguno |
|  |  |  |
| **Intercambio final de nocionales** | : | Ninguno |
|  |  |  |

**Detalle del Intercambio**

La Parte A calculará el Pago Neto de la siguiente manera:

$$Pago Neto=Monto Fijo-Monto Variable$$

Donde

$N$ = PEN Nocional

Si el Pago Neto es negativo, la Parte A deberá pagar el valor absoluto del Pago Neto a la Parte B. El pago a efectuarse a favor de la Parte B será abonado en la Cuenta Corriente en Moneda Nacional de la Parte B en el BCR. De no contar con una Cuenta Corriente en Moneda Nacional en el BCR, la Parte A procederá a realizar el abono en la Cuenta Corriente en Moneda Nacional en el BCR del Representante en la Liquidación designado por la Parte B.

Si el Pago Neto es positivo, la Parte B deberá pagar el Pago Neto a la Parte A. El pago a efectuarse a favor de la Parte A será debitado y cargado automáticamente de la Cuenta Corriente en Moneda Nacional de la Parte B en el BCR o, de no existir fondos suficientes en dicha cuenta, en cualquier otra cuenta de la que sea titular la Parte B en el BCR. De no contar con una Cuenta Corriente en Moneda Nacional en el BCR, la Parte A procederá a realizar el cargo en la Cuenta Corriente en Moneda Nacional en el BCR del Representante en la Liquidación designado por la Parte B.

**Ley aplicable**

Leyes de la República del Perú.

**Intercambio de confirmación de detalles de la transacción**

La Parte B se compromete por la presente a revisar cuidadosamente esta Confirmación inmediatamente después de recibida de modo que cualquier error o discrepancia puedan ser identificados y rectificados sin dilación. Si la presente Confirmación consigna correctamente los términos de nuestro acuerdo, por favor confirme dicho acuerdo mediante correo electrónico de sus representantes autorizados dirigido a la Parte A. Si la Parte A no recibiera una Confirmación mediante correo electrónico, ni una objeción a los términos de la misma en los términos del Contrato Marco, serán de aplicación las disposiciones de la Sección 2(a) del Contrato Marco.

Aceptada y confirmada en la fecha mencionada en el encabezado de este documento:

**ANEXO**

**Detalle de propuestas asignadas**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Número de Propuesta** | **Nocional** | **Tasa Fija (%)** |
| 1 | Montos en unidades con dos decimales |  |
| 2 |  |  |
| 3 |  |  |
| 4 |  |  |
| 5 |  |  |
| 6 |  |  |
| 7 |  |  |
| 8 |  |  |
| 9 |  |  |
| 10 |  |  |
|  |  |  |
| **PEN Nocional** | Suma de las propuestas |  |