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 CAMBIARIO COMPRA**

Número de referencia de la transacción: [**Número de Operación|**]

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 Cambiarios 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 | : | [●] |
|  |  |
| Agente de Cálculo | : | Parte A |
|  |  |  |
| PEN Nocional | : | PEN [●]Corresponde a la suma del nocional en PEN de las propuestas asignadas en la transacción |
|  |  |  |
| USD Nocional | : | USD [●](Igual a PEN Nocional dividido entre el Tipo de Cambio Inicial) |
|  |  |  |
| Tipo de Cambio Inicial | : | PEN [●] por 1 USD |
|  |  |  |
| Tipo de Tasa PEN | : | [●](Tasa Fija o Tasa Variable) |
|  |  |  |
| Tasa Fija PEN | : | [●](Solo aplica si Tipo de Tasa PEN es Tasa Fija) |
|  |  |  |
| Divisa del Contrato | : | PEN |
|  |  |  |
| Divisa de Terminación Anticipada | : | PEN |
|  |  |  |
| **Interés PEN:** |  |  |
|  |  |  |
| Monto Nocional | : | PEN Nocional |
|  |  |  |
| Fecha de Pago de la Tasa PEN | : | En la Fecha de Vencimiento |
|  |  |  |
| Ajuste del Día Hábil Siguiente Modificado | : | Será el Día Hábil siguiente a la Fecha de Vencimiento |
|  |  |  |
| Cálculo de la Tasa PEN | : | Si el Tipo de Tasa PEN es igual a Tasa Fija, la Tasa PEN será la Tasa Fija PEN. Si el Tipo de Tasa PEN es igual a Tasa Variable, la Tasa PEN 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 Acumulado de un día calendario anterior a la Fecha de Inicio*IONT-1* = Índice Acumulado de un día calendario anterior a la Fecha de VencimientoEl resultado será redondeado a seis decimales. |
|  |  |  |
| Tasa Variable | : | Para cualquier día calendario, el Índice Acumulado es publicado por el BCR en su página web:<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. |
|  |  |  |
| Interés PEN | : | Si el Tipo de Tasa PEN es igual a Tasa Variable, en la Fecha de Vencimiento, el Interés PEN se calculará de la siguiente manera:$$N×\left[\frac{ION\_{T-1}}{ION\_{t-1}}-1\right]$$Si el Tipo de Tasa PEN es igual a Tasa Fija, en la Fecha de Vencimiento, el Interés PEN se calculará de la siguiente manera:$N×\left[\left(1+r\_{PEN}\right)^{t/360}-1\right]$Donde$N$ = PEN Nocional$r\_{PEN}$ = Tasa Fija PENt = Periodo de Cálculo de la Tasa USD |
|  |  |  |
| Días Hábiles para determinar el Índice Acumulado | :  | Lima |
|  |  |  |
| Días Hábiles para la Tasa Variable  | :  | Lima |
|  |  |  |
| **Interés USD** |  |  |
|  |  |  |
| Monto Nocional  | : | USD Nocional |
|  |  |  |
| Fecha de Pago de la Tasa USD | : | En la Fecha de Vencimiento |
|  |  |  |
| Ajuste del Día Hábil Siguiente Modificado | : | Será el Día Hábil siguiente a la Fecha de Vencimiento |
|  |  |  |
| Periodo de Cálculo de la Tasa USD | : | Desde la Fecha de Inicio, incluyéndola, hasta la Fecha de Vencimiento, excluyéndola |
|  |  |  |
| Tasa USD | : | La correspondiente a cada propuesta asignada en la transacción según se detalla en el Anexo |
|  |  |  |
| Interés USD | : | Suma de los intereses expresados en PEN de todas las propuestas asignadas en la transacción. Para cada propuesta asignada, los intereses expresados en PEN se calculan de la siguiente manera:$$TC\_{T}×\frac{N\_{i}}{TC\_{0}}×\left[\left(1+r\_{i}\right)^{^{t}/\_{360}}-1 \right]$$ Donde$N\_{i}$ *=* Nocional en PEN de la propuesta i-ésima$TC\_{0}$= Tipo de Cambio Inicial$TC\_{T}$ = Tipo de Cambio Final$r\_{i}$ = Tasa Fija de la propuesta i-ésima*t =* Periodo de Cálculo de la Tasa USDEl Anexo contiene el detalle de las propuestas asignadas. |
|  |  |  |
| Base cálculo de intereses de la Tasa USD | : | Actual/360 |
|  |  |  |
| Días Hábiles para la Tasa Fija  | :  | Lima |
|  |  |  |
| Cálculo del Tipo de Cambio Final | : | El Tipo de Cambio Final será calculado conforme a la Nota Metodológica sobre el Cálculo del Tipo de Cambio Promedio para las Operaciones del BCRP, publicada en su portal institucional:<http://www.bcrp.gob.pe/> |
|  |  |  |
| Tipo de Cambio Final | : | El Tipo de Cambio Final será igual al tipo de cambio promedio publicado en la Fecha de Vencimiento por el BCR en su portal institucional. |

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

**Liquidación**

En la Fecha de Vencimiento, la Parte A calculará el Pago Neto expresado en PEN de la siguiente manera:

$$Interés a Recibir=Interés USD+N×\left(\frac{TC\_{T}}{TC\_{0}}-1\right)$$

$$Interés a Pagar=Interés PEN$$

$$Pago Neto=Interés a Recibir-Interés a Pagar$$

Donde

$TC\_{T}$ = Tipo de Cambio Final

$TC\_{0}$ = Tipo de Cambio Inicial

$N$ = 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 B deberá enviar sus instrucciones sobre el destino de los fondos a más tardar el Día Hábil previo a la Fecha de Vencimiento. De lo contrario, se emitirá un cheque por el importe del pago, el que podrá ser recogido en el Departamento de Caja del BCR a partir de las 14:00 horas de la Fecha de Vencimiento.

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 B deberá enviar sus órdenes de débito emitidas por una o más instituciones financieras con Cuenta Corriente en Moneda Nacional en el BCR, que deberán ser enviadas al BCR hasta las 16:00 horas del Día Hábil anterior a la Fecha de Vencimiento, salvo disposición especial del BCR. Dichas órdenes deberán ser firmadas por funcionarios con poder suficiente y serán remitidas mediante facsímil con clave u otro medio autorizado por el BCR, al Departamento de Liquidación y Control de Operaciones Internas de la Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera del BCR.

**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.

**ANEXO**

**Detalle de propuestas asignadas**

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