Lima, 10 de mayo 2022

**CS00125-22010929**

Señor

**Alix Godos**

Intendente General

**Intendencias General de Supervisión de Conductas**

Av. Santa Cruz N° 315

Miraflores.-

Ref.: Expediente Nº 2016002661 - Circular Nº 285-2015-SMV/11.1

Nos dirigimos a usted para dar respuesta al circular Nº 285-2015-SMV/11.1. con fecha 21 de diciembre de 2015, mediante la cual se nos consultan los criterios que consideramos para la remisión de información relacionada a nuestra posición en instrumentos derivados, vía hechos de importancia.

En ese contexto, se envía el anexo N° 1 respecto a nuestra posición en instrumentos derivados al 30 de abril de 2022.

Sin otro particular, quedo de usted.

Atentamente,

María Milagros Roman Rubio

Jefe de Contabilidad e Impuestos

**Anexo**

**POSICIÓN MENSUAL EN INSTRUMENTOS DERIVADOS**

|  |  |
| --- | --- |
| Emisor: | RED DE ENERGÍA DEL PERU |
| Al cierre del: | 30 DE ABRIL DE 2022 |

**DETALLE DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS**

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Instrumento Derivado (1) | Finalidad (2) |  Monto (3)  | Activo o Variable (4) | Moneda |  Valor Razonable  |
| Mes actual (en miles) | Mes anterior (en miles) |
| SWAP CCS1 | COBERTURA | 104,140 | PRÉSTAMO | USD | 13,828 | 12,873 |
| SWAP CCS2 | COBERTURA | 77,305 | PRÉSTAMO | USD | 10,933 | 10,035 |

**GANANCIA/PÉRDIDAS ACUMULADAS**

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  | **USD****(EN MILES)** |   |  |  |  |
| Importe de ganancia/pérdida total acumulada en el año por Instrumentos Financieros Derivados**(6)**:  |   |  1,947 |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
| Información adicional: NINGUNA |  |  |  |  |  |

***Notas:***

1. Forward, Futuro, Opción, Swap, entre otras.
2. De acuerdo a las Normas Internacionales de Información Financiera (NIIF) califican de Cobertura o Negociación.
3. Monto nocional o Valor nominal del contrato.
4. En caso de derivados de cobertura representa el Activo o Pasivo que se está coberturando y en caso de derivados de negociación es la variable de referencia.
5. Moneda de presentación de la información financiera intermedia individual.
6. Representa el total de ingresos y/o gastos de ***todos***sus instrumentos financieros derivados, lo que incluye: (i) los ingresos y/o gastos por instrumentos derivados acumulado en el año que se registran en el ***Estado de Resultados***; y, (ii) el total de variación acumulada al cierre del período de los instrumentos derivados que se registran en ***Otros Resultados Integrales***.