



Señores
SUPERINTENDENCIA DEL MERCADO DE VALORES
BOLSA DE VALORES DE LIMA

**ASUNTO: HECHO DE IMPORTANCIA -
DERIVADOS**

GF HI-021-2021

Lima, 15 de noviembre de 2021

Atención: Registro Público del Mercado de Valores

De nuestra consideración:

De conformidad con lo dispuesto por el artículo 28 del Texto Único Ordenado de la Ley del Mercado de Valores, aprobado por Decreto Supremo No. 93-2002-EF, y por el artículo 3 y Anexo N° 2 del Reglamento de Hechos de Importancia e Información Reservada, aprobado por Resolución SMV No. 005-2014-SMV/01, cumplimos con remitirles la información relacionada con la posición en instrumentos financieros derivados de la empresa al cierre del mes de octubre de 2021 (con base en los Estados Financieros Trimestrales a septiembre de 2021).

Sin otro particular, quedamos de ustedes.

Atentamente,

Alberto Salinas
Representante Bursátil

ENGIE Energía Perú S.A.
Av. República de Panamá 3490,
San Isidro, Lima 27 - Perú
T +51 1 616 7979
www.engie-energia.pe

POSICIÓN MENSUAL EN INSTRUMENTOS DERIVADOS

(Numeral 18.1, Anexo 1 del Reglamento de Hechos de Importancia e Información Reservada)

Emisor:	ENGIE Energía Perú S.A.
Al cierre de:	Octubre 2021 (Con base en los Estados Financieros Trimestrales a setiembre 2021)

DETALLE DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS

Instrumento Derivado ⁽¹⁾	Finalidad ⁽²⁾	Monto Nocialal ⁽³⁾	Activo / Pasivo o Variable ⁽⁴⁾	Moneda ⁽⁵⁾	Valor Razonable	
					Mes actual	Mes anterior
Swap de moneda y tasa de interés (Cross currency interest rate swap)	Cobertura	247,904	3er Programa de Bonos Corporativos (1ra, 2da y 3ra emisión, series A y B, con vencimiento en jun26, jun24 jun27 y jun28 respectivamente)	Miles USD	203,211	196,031
Cross currency and interest rate swap	Cobertura	50,000	Préstamos Bancarios	Miles USD	40,536	39,103
Forwards	Cobertura	49,292(d)	Préstamos Sintéticos	Miles USD	51,405	49,589

GANANCIA / PÉRDIDAS ACUMULADAS

	Moneda ⁽⁵⁾	MILES USD
Importe de ganancia / pérdida total acumulada en el año por instrumentos financieros derivados ⁽⁶⁾		-6,577

Información adicional:

- a.- Información expresada en miles de dólares.
- b.- Instrumentos financieros correspondiente a los últimos Estados Financieros Trimestrales publicados (junio 2021), con el valor razonable actualizado a setiembre 2021.
- c.- El tipo de cambio utilizado para los meses de octubre y setiembre de 2021 fue de 3.986 y 4.132 respectivamente soles por dólar que corresponde al tipo de cambio “Compra” publicado por la SBS al 29 de octubre y 30 de setiembre de 2021, respectivamente.
- d. Durante el mes de setiembre se constituyó un nuevo instrumento financiero para un préstamo sintético.

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 nocialal 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**.