

Propuesta de Instrumento Derivado – Proceso CAP-3-2022

Ciudad de México a 25 de abril de 2022.

Oficio Número: **DT-DDP-478/2022**

Proceso Competitivo: **CAP-3-2022**

Estimado C. Carlos Alberto Garza Ibarra, Secretario de Finanzas y Tesorero General del Estado:

Por medio de la presente le informamos que es de nuestro interés participar en el proceso Competitivo CAP-3-2022 para la contratación por parte del Gobierno del Estado de Nuevo León, de un Instrumento Derivado, respecto a los Contratos Objeto de Cobertura manifestados en la carta intención.

Le hacemos llegar cordialmente nuestra oferta económica irrevocable y en firme para la venta de un Instrumento Derivado de cobertura, modalidad CAP, equivalente al saldo insoluto del Contrato de Apertura de Crédito Simple celebrado por el Estado con (i) Banobras y un Instrumento Derivado de cobertura, modalidad CAP SPREAD, por el equivalente al 50% del saldo insoluto del Contrato de Apertura de Crédito Simple celebrado por el Estado con (ii) Santander.

i) “Crédito Banobras”: Plazo 1 año (12 meses)

CAP MXN: 1 AÑO		
Fecha Inicio	25-abr-22	
Fecha Fin	25-abr-23	
Nocional MXN	3,732,596,012.43	
Amortización	De acuerdo a tabla (Anexo 1)	
Tasa ref.	TIIE 28d	
Calendario	México	
Convención	ACT/360, Following	
Strike	Prima MXN*	Prima %*
10.50%	13,256,406	0.36%
11.00%	11,240,779	0.30%
11.50%	9,627,384	0.26%

*Nivel indicativo y sujeto a cambios de mercado

Tabla (Anexo 1)

#	Fecha Inicio	Fecha Fin	Fecha revisión	Días	Monto MXN
1	25-abr-22	25-may-22	22-abr-22	30	3,732,596,012.43
2	25-may-22	27-jun-22	24-may-22	33	3,730,700,179.28
3	27-jun-22	25-jul-22	24-jun-22	28	3,728,779,700.30
4	25-jul-22	25-ago-22	22-jul-22	31	3,726,834,255.09
5	25-ago-22	26-sep-22	24-ago-22	32	3,724,863,519.09
6	26-sep-22	25-oct-22	23-sep-22	29	3,722,867,163.52
7	25-oct-22	25-nov-22	24-oct-22	31	3,720,844,855.33
8	25-nov-22	26-dic-22	24-nov-22	31	3,718,796,257.14
9	26-dic-22	25-ene-23	23-dic-22	30	3,716,721,027.17



Propuesta de Instrumento Derivado – Proceso CAP-3-2022

10	25-ene-23	27-feb-23	24-ene-23	33	3,714,618,819.21
11	27-feb-23	27-mar-23	24-feb-23	28	3,712,489,282.55
12	27-mar-23	25-abr-23	24-mar-23	29	3,710,332,061.91

ii) “Crédito Santander”: Plazo 2 años (24 meses)

CAP SPREAD MXN: 2 AÑOS		
Fecha Inicio	25-abr-22	
Fecha Fin	25-abr-24	
Nocional MXN	1,937,444,898.85	
Amortización	De acuerdo a tabla (Anexo 2)	
Tasa ref.	TIEE 28d	
Calendario	México	
Convención	ACT/360, Following	
Strike-Barrera	Prima MXN*	Prima %*
9.50% - 10.50%	13,032,711	0.67%

*Nivel indicativo y sujeto a cambios de mercado

Tabla (Anexo 2)

#	Fecha Inicio	Fecha Fin	Fecha revisión	Días	Monto MXN
1	25-abr-22	25-may-22	22-abr-22	30	1,937,444,898.85
2	25-may-22	27-jun-22	24-may-22	33	1,934,506,107.85
3	27-jun-22	25-jul-22	24-jun-22	28	1,931,530,581.85
4	25-jul-22	25-ago-22	22-jul-22	31	1,928,517,861.85
5	25-ago-22	26-sep-22	24-ago-22	32	1,925,467,482.85
6	26-sep-22	25-oct-22	23-sep-22	29	1,922,378,974.35
7	25-oct-22	25-nov-22	24-oct-22	31	1,919,251,859.35
8	25-nov-22	26-dic-22	24-nov-22	31	1,916,085,655.35
9	26-dic-22	25-ene-23	23-dic-22	30	1,912,879,873.85
10	25-ene-23	27-feb-23	24-ene-23	33	1,909,634,020.35
11	27-feb-23	27-mar-23	24-feb-23	28	1,906,347,593.35
12	27-mar-23	25-abr-23	24-mar-23	29	1,903,020,086.35
13	25-abr-23	25-may-23	24-abr-23	30	1,899,650,985.35
14	25-may-23	26-jun-23	24-may-23	32	1,896,239,770.35
15	26-jun-23	25-jul-23	23-jun-23	29	1,892,785,915.35
16	25-jul-23	25-ago-23	24-jul-23	31	1,889,288,887.35
17	25-ago-23	25-sep-23	24-ago-23	31	1,885,748,146.35
18	25-sep-23	25-oct-23	22-sep-23	30	1,882,163,145.85
19	25-oct-23	27-nov-23	24-oct-23	33	1,878,533,332.85
20	27-nov-23	26-dic-23	24-nov-23	29	1,874,858,147.35
21	26-dic-23	25-ene-24	22-dic-23	30	1,871,137,021.85

Daniel B.



Propuesta de Instrumento Derivado – Proceso CAP-3-2022

22	25-ene-24	26-feb-24	24-ene-24	32	1,867,369,382.35
23	26-feb-24	25-mar-24	23-feb-24	28	1,863,554,647.35
24	25-mar-24	25-abr-24	22-mar-24	31	1,859,692,228.35

Atentamente
Scotiabank Inverlat S.A.
Institución de Banca Múltiple, Grupo Financiero Scotiabank Inverlat.

Norma Daniela González Betancourt
Representante Legal.