

## Propuesta de Instrumento Derivado – Proceso CAP-2-2022

Ciudad de México a 19 de abril de 2022.

Oficio Número: **DT-DDP-440/2022**

Proceso Competitivo: **CAP-2-2022**

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-2-2022 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, por el equivalente al 50% del saldo insoluto respecto a los Contratos de Apertura de Crédito Simple celebrados por el Estado con i) Banobras

### **i) Banobras: Plazo 2 años (24 meses) o 3 años (36 meses)**

CAP MXN: 2 AÑOS		
Fecha Inicio	19-abr-22	
Fecha Fin	19-abr-24	
Nocional MXN	1,867,233,757.99	
Amortización	ver calendario	
Tasa ref.	TIIE 28d	
Calendario	México	
Convención	ACT/360, Following	
Escenario 1		
Strike	Prima MXN*	Prima %*
9.50%	27,891,509	1.49%
10.00%	24,886,764	1.33%
10.50%	22,287,632	1.19%

\*Nivel indicativo y sujeto a cambios de mercado

CAP MXN: 3 AÑOS		
Fecha Inicio	19-abr-22	
Fecha Fin (S1)	19-abr-25	
Nocional MXN	1,867,233,757.99	
Amortización	ver calendario	
Tasa ref.	TIIE 28d	
Calendario	México	
Convención	ACT/360, Following	
Escenario 2		
Strike	Prima MXN*	Prima %*
9.50%	54,405,381	2.91%
10.00%	50,217,997	2.69%
10.50%	46,770,042	2.50%

\*Nivel indicativo y sujeto a cambios de mercado



**Propuesta de Instrumento Derivado – Proceso CAP-2-2022**

#	Fecha Inicio	Fecha Fin	Fecha revisión	Días	Monto MXN
1	19-abr-22	19-may-22	18-abr-22	30	1,867,233,757.99
2	19-may-22	20-jun-22	18-may-22	32	1,866,298,006.18
3	20-jun-22	19-jul-22	17-jun-22	29	1,865,350,089.60
4	19-jul-22	19-ago-22	18-jul-22	31	1,864,389,850.11
5	19-ago-22	19-sep-22	18-ago-22	31	1,863,417,127.50
6	19-sep-22	19-oct-22	15-sep-22	30	1,862,431,759.50
7	19-oct-22	22-nov-22	18-oct-22	34	1,861,433,581.71
8	22-nov-22	19-dic-22	18-nov-22	27	1,860,422,427.62
9	19-dic-22	19-ene-23	16-dic-22	31	1,859,398,128.52
10	19-ene-23	20-feb-23	18-ene-23	32	1,858,360,513.53
11	20-feb-23	21-mar-23	17-feb-23	29	1,857,309,409.54
12	21-mar-23	19-abr-23	17-mar-23	29	1,856,244,641.21
13	19-abr-23	19-may-23	18-abr-23	30	1,855,166,030.88
14	19-may-23	19-jun-23	18-may-23	31	1,854,073,398.62
15	19-jun-23	19-jul-23	16-jun-23	30	1,852,966,562.15
16	19-jul-23	21-ago-23	18-jul-23	33	1,851,845,336.80
17	21-ago-23	19-sep-23	18-ago-23	29	1,850,709,535.52
18	19-sep-23	19-oct-23	18-sep-23	30	1,849,558,968.82
19	19-oct-23	21-nov-23	18-oct-23	33	1,848,393,444.75
20	21-nov-23	19-dic-23	17-nov-23	28	1,847,212,768.87
21	19-dic-23	19-ene-24	18-dic-23	31	1,846,016,744.21
22	19-ene-24	19-feb-24	18-ene-24	31	1,844,805,171.22
23	19-feb-24	19-mar-24	16-feb-24	29	1,843,577,847.79
24	19-mar-24	19-abr-24	15-mar-24	31	1,842,334,569.15
25	19-abr-24	20-may-24	18-abr-24	31	1,841,075,127.89
26	20-may-24	19-jun-24	17-may-24	30	1,839,799,313.89
27	19-jun-24	19-jul-24	18-jun-24	30	1,838,506,914.31
28	19-jul-24	19-ago-24	18-jul-24	31	1,837,197,713.54
29	19-ago-24	19-sep-24	16-ago-24	31	1,835,871,493.15
30	19-sep-24	21-oct-24	18-sep-24	32	1,834,528,031.90
31	21-oct-24	19-nov-24	18-oct-24	29	1,833,167,105.66
32	19-nov-24	19-dic-24	15-nov-24	30	1,831,788,487.37
33	19-dic-24	20-ene-25	18-dic-24	32	1,830,391,947.05
34	20-ene-25	19-feb-25	17-ene-25	30	1,828,977,251.70
35	19-feb-25	19-mar-25	18-feb-25	28	1,827,544,165.31
36	19-mar-25	21-abr-25	18-mar-25	33	1,826,092,448.80

Atentamente

Scotiabank Inverlat S.A.

Institución de Banca Múltiple, Grupo Financiero Scotiabank Inverlat.



**Norma Daniela González Betancourt**  
Representante Legal.