

Cuenta Pública 2016
Relación de Esquemas Bursátiles y de Coberturas Financieras

(Pesos)

Ente Público: Poder Ejecutivo del Estado de Zacatecas

Institución	Condiciones	Fecha de Contratación	Fecha de Vencimiento	Base de Cobertura	Cobertura	Costo de la Cobertura
BBVA Bancomer	CAP	31/oct/2014	31/oct/2017	10%	\$ 1,576,575,243	\$ 2,812,000
Banorte	CAP	20/feb/2015	31/ene/2018	10%	\$ 85,213,467	\$ 323,000
Banorte	CAP	20/feb/2015	31/ene/2018	10%	\$ 1,338,211,290	\$ 5,088,000
BBVA Bancomer	CAP	19/feb/2015	31/ene/2017	10%	\$ 173,241,509	\$ 103,000
BBVA Bancomer	CAP	14/may/2015	02/may/2017	10%	\$ 120,423,605	\$ 60,000
HSBC	CAP	12/jun/2015	31/may/2017	10%	\$ 450,776,815	\$ 224,506
BBVA Bancomer	CAP	26/ago/2015	24/ago/2017	10%	\$ 305,333,333	\$ 155,863
BBVA Bancomer	CAP	24/feb/2014	25/jul/2016	10%	\$ 835,850,000	\$ 1,350,000
HSBC	COLLAR	12/abr/2016	31/mar/2019	Venta 4.5% - Compra 7%	\$ 500,000,000	\$ 263,237
Santander	COLLAR	31/mar/2016	19/mar/2019	Venta 4.5% - Compra 7%	\$ 500,000,000	\$ 151,422
Banorte	COLLAR	05/ago/2016	31/jul/2019	Venta 5% - Compra 7.5%	\$ 1,050,000,000	\$ 262,500.00

NOTA:

1. CAP es un techo o límite superior de un tipo de interés, se desarrollan por las instituciones financieras. Se trata de uno de los instrumentos de garantía de los tipos de interés que se utilizan para limitar los riesgos de fluctuación de dichas tasas.
2. COLLAR es un instrumento de cobertura que se utiliza, en los préstamos con interés variable, para limitar el riesgo de subida del tipo de interés entre dos bandas.
3. Los montos plasmados en COLLAR es un promedio mensual pagado en el año 2016, ya que es variable por mes.