



4

PODER EJECUTIVO DEL ESTADO DE MÉXICO



RELACIÓN DE ESQUEMAS BURSATILES Y DE COBERTURAS FINANCIERAS

COBERTURAS FINANCIERAS

COBERTURAS CONTRATADAS POR EL GEM CON BANOBRAS Y BANCOMER
GPO / SWAP / CAP
AL 31 de Diciembre de 2016

BANCO	GPO				SWAP		
	FECHA DE CONTRATO ORIGINA	IMPORTE DE CRÉDITO	SALDO INSOLUTO AL 31 DE DICIEMBRE 2016	MONTO EXPUESTO 27%	FECHA DE OPERACIÓN	TASA VARIABLE	TASA FIJA
BANAMEX	25-04-08	5,214,617,208.58	4,117,466,565.19	1,111,715,972.60			
BBVA BANCOMER	25-04-08	5,546,458,788.26	4,801,593,045.25	1,296,430,122.22			
BBVA BANCOMER	25-04-08	453,541,211.74	392,632,562.72	106,010,791.93			
SANTANDER	25-04-08	1,370,063,723.15	1,081,803,581.46	292,086,966.99	29-04-08	4.0655%	8.450%
INTERACCIONES	25-04-08	590,160,105.51	519,096,039.84	140,155,930.76	29-04-08	4.0655%	8.748%
BANORTE	25-04-08	3,000,000,000.00	2,787,961,041.74	752,749,841.27	29-04-08	4.0655%	8.795%
INBURSA	25-04-08	500,000,000.00	394,800,461.89	106,596,124.71	29-04-08	4.0655%	8.689%
BANORTE	16-10-14	4,762,546,799.47	4,711,203,592.43	1,272,024,969.96	16-10-14	4.0655%	8.749%
BANORTE	16-10-14	1,905,018,719.83	1,884,481,437.02	508,809,988.00	16-10-14	4.0655%	8.749%
HSBC	25-04-08	1,500,000,000.00	1,184,401,385.71	319,788,374.14	29-04-08	4.0655%	8.689%

Definiciones:
SWAP: Contrato de Intercambio de Flujos de Tasa
GPO: Garantía de Pago Oportuno
CAP: Operación de Tasa (Tasa de Capitalización)

CAP

BANCO	CAP			
	FECHA DE CONTRATO CAP	FECHA DE VENCIMIENTO CAP	SALDO INSOLUTO DEL CREDITO AL 31/12/2016	IMPORTE DE LA PRIMA
BBVA BANCOMER	02-dic-14	30-nov-17	3,595,021,064.78	14,665,343.00
TOTAL				14,665,343.00

ESQUEMAS BURSATILES

BANOBRAS								
Folio	Nocional Vigente	Derivado	Contraparte	Valuación A	Mon. A	Valuación B	Mon. B	Diferencia
57	2,794,072,815.73	IRS FIJA[V] - T28[V]	EDO MEX	1,999,061,583.35	MXN	1,850,647,724.58	MXN	148,413,858.77
59	1,862,715,210.49	IRS FIJA[V] - T28[V]	EDO MEX	1,128,601,802.13	MXN	1,021,404,066.31	MXN	107,197,735.82
65	4,656,788,026.22	IRS FIJA[V] - T28[V]	EDO MEX	2,821,504,505.36	MXN	2,553,510,165.82	MXN	267,994,339,339.54
67	1,193,498,145.20	IRS FIJA[V] - T28[V]	EDO MEX	526,982,147.18	MXN	470,124,144.32	MXN	56,858,002.86
68	521,144,378.09	IRS FIJA[V] - T28[V]	EDO MEX	309,341,106.47	MXN	285,239,434.40	MXN	27,101,672.07
69	397,832,715.07	IRS FIJA[V] - T28[V]	EDO MEX	175,660,715.72	MXN	156,708,048.09	MXN	18,952,667.63
73	1,090,112,341.59	IRS FIJA[V] - T28[V]	EDO MEX	120,859,321.04	MXN	99,687,421.10	MXN	21,171,899.94
MTM								647,690,176.63