

México, Ciudad de México, a 25 de Abril de 2021.

GOBIERNO DEL ESTADO DE NUEVO LEÓN.
Secretaría de Finanzas y Tesorería General del Estado.
P R E S E N T E

Atención: Lic. Carlos Alberto Garza Ibarra
Secretario de Finanzas y Tesorero General Estado de Nuevo León.
Ref.: "Propuesta de Instrumento Derivado" oficio No. DT-DDP-480/2022

En relación con el oficio No. DT-DDP-480/2022 de fecha 21 de Abril de 2021 relativo a la invitación a participar en el proceso competitivo CAP-3-para la contratación de un Instrumento Derivado para cubrir la tasa de referencia (TIIE a 28 días) en el servicio de la deuda de los Créditos por \$4,049 mdp, y \$4,089 mdp contratados por el Estado con Banobras y Santander el 26 de enero de 2007 y 12 de marzo de 2018, respectivamente; al respecto le informo la cotización que a continuación se detalla:

1. Características del producto o Modalidad de Opción Derivada.

Se propone celebrar una o más operaciones derivadas tipo CAP o techo de tasa de interés sobre cierto nivel de la TIIE.

2. Plazo de las coberturas. - El plazo es de 1 año (del 25 de Abril de 2022 al 25 de Abril de 2023) y 2 años (del 25 de Abril de 2022 al 25 de Abril de 2024)

3. Vigencia.- 24 (veinticuatro) horas a partir de la presentación de la oferta.

4. Plazo de Cierre.-24 (veinticuatro) horas a partir de la recepción de la oferta.

5. Vigencia del Contrato.-Por tiempo indeterminado.

6. Activo Subyacente.- Tasa de Interés Interbancaria de Equilibrio 28 días (TIIE).

7. Nacionales:

Santander \$4,089'277,741.69 (cuatro mil ochenta y nueve millones doscientos setenta y siete mil setecientos cuarenta y un pesos 69/100 M.N.)

Banobras \$4,049'500,00.00 (cuatro mil cuarenta y nueve millones quinientos mil pesos 00/100 M.N.)

8. Amortizaciones conforme a las tablas de este documento para cada crédito.

9. La presente oferta se emite a las 9:30 horas del día 25 de Abril de 2022

10. Las propuestas abajo mencionadas tienen carácter de irrevocables durante la vigencia de la oferta.

11. Comisiones y costos. -El costo de las primas puede pagarse en 24 (veinte cuatro) horas de haberse celebrado la operación.



12. Niveles. –

| CAP | |
|------------|----------------|
| BANOBRAS | 12 Meses |
| Strike Cap | Prima en pesos |
| 10.50 | 12,721,280 |
| 11.00 | 10,867,288 |
| 11.50 | 9,431,633 |

| Cap Spread | |
|--------------|----------------|
| BANOBRAS | 12 Meses |
| Stirkes | Prima en pesos |
| 9.50 - 10.50 | 7,727,424 |

| Cap Spread | |
|--------------|----------------|
| Santander | 24 Meses |
| Stirkes | Prima en pesos |
| 9.50 - 10.50 | 10,408,113 |

| Crédito Banobras | | | | |
|------------------|--------------|-------------------|---|--|
| Período | Fecha Inicio | Fecha Vencimiento | Saldo Insoluto a la Fecha de Inicio del Período | Saldo a Cubrir (100% del Saldo Insoluto) |
| 1 | 4/25/2022 | 5/25/2022 | \$ 3,732,596,012.43 | \$ 3,732,596,012.43 |
| 2 | 5/25/2022 | 6/27/2022 | \$ 3,730,700,179.28 | \$ 3,730,700,179.28 |
| 3 | 6/27/2022 | 7/25/2022 | \$ 3,728,779,700.30 | \$ 3,728,779,700.30 |
| 4 | 7/25/2022 | 8/25/2022 | \$ 3,726,834,255.09 | \$ 3,726,834,255.09 |
| 5 | 8/25/2022 | 9/26/2022 | \$ 3,724,863,519.09 | \$ 3,724,863,519.09 |
| 6 | 9/26/2022 | 10/25/2022 | \$ 3,722,867,163.52 | \$ 3,722,867,163.52 |
| 7 | 10/25/2022 | 11/25/2022 | \$ 3,720,844,855.33 | \$ 3,720,844,855.33 |
| 8 | 11/25/2022 | 12/26/2022 | \$ 3,718,796,257.14 | \$ 3,718,796,257.14 |
| 9 | 12/26/2022 | 1/25/2023 | \$ 3,716,721,027.17 | \$ 3,716,721,027.17 |
| 10 | 1/25/2023 | 2/27/2023 | \$ 3,714,618,819.21 | \$ 3,714,618,819.21 |
| 11 | 2/27/2023 | 3/27/2023 | \$ 3,712,489,282.55 | \$ 3,712,489,282.55 |
| 12 | 3/27/2023 | 4/25/2023 | \$ 3,710,332,061.91 | \$ 3,710,332,061.91 |

| Crédito Santander | | | | |
|-------------------|--------------|-------------------|---|---|
| Período | Fecha Inicio | Fecha Vencimiento | Saldo Insoluto a la Fecha de Inicio del Período | Saldo a Cubrir (50% del Saldo Insoluto) |
| 1 | 4/25/2022 | 5/25/2022 | \$ 3,874,889,797.69 | \$ 1,937,444,898.85 |
| 2 | 5/25/2022 | 6/27/2022 | \$ 3,869,012,215.69 | \$ 1,934,506,107.85 |
| 3 | 6/27/2022 | 7/25/2022 | \$ 3,863,061,163.69 | \$ 1,931,530,581.85 |
| 4 | 7/25/2022 | 8/25/2022 | \$ 3,857,035,723.69 | \$ 1,928,517,861.85 |
| 5 | 8/25/2022 | 9/26/2022 | \$ 3,850,934,965.69 | \$ 1,925,467,482.85 |
| 6 | 9/26/2022 | 10/25/2022 | \$ 3,844,757,948.69 | \$ 1,922,378,974.35 |
| 7 | 10/25/2022 | 11/25/2022 | \$ 3,838,503,718.69 | \$ 1,919,251,859.35 |
| 8 | 11/25/2022 | 12/26/2022 | \$ 3,832,171,310.69 | \$ 1,916,085,655.35 |
| 9 | 12/26/2022 | 1/25/2023 | \$ 3,825,759,747.69 | \$ 1,912,879,873.85 |
| 10 | 1/25/2023 | 2/27/2023 | \$ 3,819,268,040.69 | \$ 1,909,634,020.35 |
| 11 | 2/27/2023 | 3/27/2023 | \$ 3,812,696,186.69 | \$ 1,906,347,593.35 |
| 12 | 3/27/2023 | 4/25/2023 | \$ 3,806,040,172.69 | \$ 1,903,020,086.35 |
| 13 | 4/25/2023 | 5/25/2023 | \$ 3,799,301,970.69 | \$ 1,899,650,985.35 |
| 14 | 5/25/2023 | 6/26/2023 | \$ 3,792,479,540.69 | \$ 1,896,239,770.35 |
| 15 | 6/26/2023 | 7/25/2023 | \$ 3,785,571,830.69 | \$ 1,892,785,915.35 |
| 16 | 7/25/2023 | 8/25/2023 | \$ 3,778,577,774.69 | \$ 1,889,288,887.35 |
| 17 | 8/25/2023 | 9/25/2023 | \$ 3,771,496,292.69 | \$ 1,885,748,146.35 |
| 18 | 9/25/2023 | 10/25/2023 | \$ 3,764,326,291.69 | \$ 1,882,163,145.85 |
| 19 | 10/25/2023 | 11/27/2023 | \$ 3,757,066,665.69 | \$ 1,878,533,332.85 |
| 20 | 11/27/2023 | 12/26/2023 | \$ 3,749,716,294.69 | \$ 1,874,858,147.35 |
| 21 | 12/26/2023 | 1/25/2024 | \$ 3,742,274,043.69 | \$ 1,871,137,021.85 |
| 22 | 1/25/2024 | 2/26/2024 | \$ 3,734,738,764.69 | \$ 1,867,369,382.35 |
| 23 | 2/26/2024 | 3/25/2024 | \$ 3,727,109,294.69 | \$ 1,863,554,647.35 |
| 24 | 3/25/2024 | 4/25/2024 | \$ 3,719,384,466.69 | \$ 1,859,692,228.35 |



Para confirmación de cierre de operación contactar a:
Ivvic Daniel Ponce Alfaro (55) 22 62 37 04

Atentamente,
BANCO NACIONAL DE MÉXICO, S.A.,
INTEGRANTE DEL GRUPO FINANCIERO BANAMEX

Ivvic Daniel Ponce Alfaro
Apoderado

Banco Nacional de México, S.A., integrante del Grupo Financiero Banamex ("CITIBANAMEX"), se complace en presentar la cotización presente. Los precios mencionados fueron obtenidos al 25 de abril de 2022. En caso de que el Cliente pretenda celebrar la operación, se deberá de confirmar de manera telefónica, así como cumplir con los requisitos jurídicos aplicables, incluyendo de manera enunciativa, más no limitativa, con lo establecido en la Ley de Disciplina Financiera de las Entidades Federativas y los Municipios, con las Condiciones Generales del Proceso Competitivo CAP-3-para cubrir la tasa de referencia (TIIE a 28 días) en el servicio de la deuda de los Créditos por \$4,049 mdp, y \$4,089 mdp contratados por el Estado con Banobras y Santander el 26 de enero de 2007 y 12 de marzo de 2018, respectivamente, No. DT-DDP-480/2022 de fecha 21 de abril de 2021.

La presente cotización se emite a petición del solicitante, en el entendido de que el solicitante comprende los términos y condiciones de la operación ofrecida. Citibanamex no actúa como asesor respecto de la operación descrita. En caso de dudas, el solicitante deberá allegarse de la asesoría independiente fiscal, legal, contable y financiera necesaria para evaluar los alcances de la operación.

Los datos contenidos en la presente cotización constituyen información confidencial y no podrán ser divulgados sin el consentimiento previo y por escrito por parte de Citibanamex.