

México, Ciudad de México, a 23 de febrero 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” crédito Santander

En relación al oficio No. DT-DDP-128/2021 de fecha 12 de febrero de 2021 relativo a la invitación a participar en el proceso competitivo CAP-1-2021 para la Contratación de una Opción Derivada para cubrir la tasa de referencia (TIIE a 28 días) en el servicio de la deuda derivado de los créditos por 1,300 y 1,250 mdp contratados por el Estado con Santander y Banorte el 11 y 17 de octubre 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 operación derivada tipo CAP o techo de tasa de interés sobre cierto nivel de la TIIE.

2. Plazo de la cobertura.- El plazo es de 2 y 3 años a partir del 25 de Febrero del presente.
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. Ncional.- \$690,030,351.90 (Seiscientos noventa millones treinta mil trescientos cincuenta y un pesos 90/100 M.N) y conforme al calendario de pagos.

	Inicio	Vencimiento	Saldo Insoluto
1	25-Feb-21	25-Mar-21	690,370,845.42
2	25-Mar-21	26-Apr-21	689,703,095.11
3	26-Apr-21	25-May-21	689,026,997.92
4	25-May-21	25-Jun-21	688,342,449.52
5	25-Jun-21	26-Jul-21	687,649,344.26
6	26-Jul-21	25-Aug-21	686,947,575.19
7	25-Aug-21	27-Sep-21	686,237,034.01
8	27-Sep-21	25-Oct-21	685,517,611.06
9	25-Oct-21	25-Nov-21	684,789,195.32
10	25-Nov-21	27-Dec-21	684,051,674.39
11	27-Dec-21	25-Jan-22	683,304,934.45
12	25-Jan-22	25-Feb-22	682,548,860.26
13	25-Feb-22	25-Mar-22	681,783,335.14
14	25-Mar-22	25-Apr-22	681,008,240.95
15	25-Apr-22	25-May-22	680,223,458.09
16	25-May-22	27-Jun-22	679,428,865.44
17	27-Jun-22	25-Jul-22	678,624,340.38
18	25-Jul-22	25-Aug-22	677,809,758.76

	Inicio	Vencimiento	Saldo Insoluto
19	25-Aug-22	26-Sep-22	676,984,994.87
20	26-Sep-22	25-Oct-22	676,149,921.43
21	25-Oct-22	25-Nov-22	675,304,409.57
22	25-Nov-22	26-Dec-22	674,448,328.82
23	26-Dec-22	25-Jan-23	673,581,547.06
24	25-Jan-23	27-Feb-23	672,703,930.52
25	27-Feb-23	27-Mar-23	671,815,343.78
26	27-Mar-23	25-Apr-23	670,915,649.70
27	25-Apr-23	25-May-23	670,004,709.45
28	25-May-23	26-Jun-23	669,082,382.44
29	26-Jun-23	25-Jul-23	668,148,526.35
30	25-Jul-23	25-Aug-23	667,202,997.06
31	25-Aug-23	25-Sep-23	666,245,648.65
32	25-Sep-23	25-Oct-23	665,276,333.38
33	25-Oct-23	27-Nov-23	664,294,901.67
34	27-Nov-23	26-Dec-23	663,301,202.07
35	26-Dec-23	25-Jan-24	662,295,081.22
36	25-Jan-24	26-Feb-24	661,276,383.86

8. La presente oferta se emite a las 10 horas del día 23 de Febrero de 2021.
9. Las propuestas abajo mencionadas tienen carácter de irrevocables durante la vigencia de la oferta.
10. Comisiones y costos.-El costo de la primas puede pagarse en 24 (veinte cuatro) horas de haberse celebrado la operación.
11. Niveles.-

23-feb-21			Plazo	2 años	Plazo	3 años
Monto	Cobertura	Strike	Prima Pesos		Prima Pesos	
690,370,845	CAP	6.00%	905,000		4,213,000	
		7.00%	486,000		2,859,000	
		8.00%	427,000		2,408,000	
		9.00%	323,000		2,069,000	

Para confirmación de cierre de operación contactar a:
Oscar Velazquez Frausto (55) 2262-8334

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

Ricardo Peña Ortiz
Tesorería y Mercados
175 - 46

Ricardo Peña Ortiz

Israel Chorley Moreno
Director de Zona BGI
166 - 35

Israel Chorley Moreno

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 23 de Febrero de 2021. 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-1-2021 por Invitación para la Contratación de una Opción Derivada para cubrir la tasa de referencia (TIIE a 28 días) en el servicio de la deuda derivado de los créditos por 1,300 y 1,250 mdp contratados por el Estado con Santander y Banorte el 11 y 17 de octubre de 2018 respectivamente, conforme al oficio No. DT-DDP-128/2021 de fecha 12 de febrero 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.