

Términos y Condiciones

Cobertura de tasa de interés ("Cap")

Atención:

Secretario de Finanzas y Tesorero General del Estado
Lic. Carlos Alberto Garza Ibarra

HSBC manifiesta, su intención de participar en el proceso y de acepta sujetarse a los presentes lineamientos del proceso competitivo.

CONDICIONES GENERALES DEL DERIVADO																																																																									
Parte A	HSBC México, S.A., Institución de Banca Múltiple, Grupo Financiero HSBC																																																																								
Parte B	ESTADO DE NUEVO LEON																																																																								
Tipo de Operación:	Opción de Compra referenciada a una Tasa de Interés "CAP"																																																																								
Monto de Referencia en MXN (monto notional):	Contrato Santander: \$691,030,351.90 Contrato Banorte: \$473,397,151.13																																																																								
Monto de Prima:	<table border="1"> <thead> <tr> <th colspan="3">Credito Santander</th> <th colspan="3">Credito Banorte</th> </tr> <tr> <th>Plazo</th> <th>Strike</th> <th>Prima</th> <th>Plazo</th> <th>Strike</th> <th>Prima</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>2 Años</td> <td>6.00%</td> <td>1,175,000.00</td> <td>2 Años</td> <td>6.00%</td> <td>805,000.00</td> </tr> <tr> <td>2 Años</td> <td>7.00%</td> <td>898,000.00</td> <td>2 Años</td> <td>7.00%</td> <td>615,000.00</td> </tr> <tr> <td>2 Años</td> <td>8.00%</td> <td>760,000.00</td> <td>2 Años</td> <td>8.00%</td> <td>521,000.00</td> </tr> <tr> <td>2 Años</td> <td>9.00%</td> <td>691,000.00</td> <td>2 Años</td> <td>9.00%</td> <td>473,000.00</td> </tr> </tbody> </table> <table border="1"> <thead> <tr> <th colspan="3">Credito Santander</th> <th colspan="3">Credito Banorte</th> </tr> <tr> <th>Plazo</th> <th>Strike</th> <th>Prima</th> <th>Plazo</th> <th>Strike</th> <th>Prima</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>3 Años</td> <td>6.00%</td> <td>4,492,000.00</td> <td>3 Años</td> <td>6.00%</td> <td>3,077,000.00</td> </tr> <tr> <td>3 Años</td> <td>7.00%</td> <td>3,041,000.00</td> <td>3 Años</td> <td>7.00%</td> <td>2,083,000.00</td> </tr> <tr> <td>3 Años</td> <td>8.00%</td> <td>2,280,000.00</td> <td>3 Años</td> <td>8.00%</td> <td>1,562,000.00</td> </tr> <tr> <td>3 Años</td> <td>9.00%</td> <td>1,866,000.00</td> <td>3 Años</td> <td>9.00%</td> <td>1,278,000.00</td> </tr> </tbody> </table> <p>Precios vigentes por 24 horas.</p>	Credito Santander			Credito Banorte			Plazo	Strike	Prima	Plazo	Strike	Prima	2 Años	6.00%	1,175,000.00	2 Años	6.00%	805,000.00	2 Años	7.00%	898,000.00	2 Años	7.00%	615,000.00	2 Años	8.00%	760,000.00	2 Años	8.00%	521,000.00	2 Años	9.00%	691,000.00	2 Años	9.00%	473,000.00	Credito Santander			Credito Banorte			Plazo	Strike	Prima	Plazo	Strike	Prima	3 Años	6.00%	4,492,000.00	3 Años	6.00%	3,077,000.00	3 Años	7.00%	3,041,000.00	3 Años	7.00%	2,083,000.00	3 Años	8.00%	2,280,000.00	3 Años	8.00%	1,562,000.00	3 Años	9.00%	1,866,000.00	3 Años	9.00%	1,278,000.00
Credito Santander			Credito Banorte																																																																						
Plazo	Strike	Prima	Plazo	Strike	Prima																																																																				
2 Años	6.00%	1,175,000.00	2 Años	6.00%	805,000.00																																																																				
2 Años	7.00%	898,000.00	2 Años	7.00%	615,000.00																																																																				
2 Años	8.00%	760,000.00	2 Años	8.00%	521,000.00																																																																				
2 Años	9.00%	691,000.00	2 Años	9.00%	473,000.00																																																																				
Credito Santander			Credito Banorte																																																																						
Plazo	Strike	Prima	Plazo	Strike	Prima																																																																				
3 Años	6.00%	4,492,000.00	3 Años	6.00%	3,077,000.00																																																																				
3 Años	7.00%	3,041,000.00	3 Años	7.00%	2,083,000.00																																																																				
3 Años	8.00%	2,280,000.00	3 Años	8.00%	1,562,000.00																																																																				
3 Años	9.00%	1,866,000.00	3 Años	9.00%	1,278,000.00																																																																				
Fecha de celebración	23 de Febrero de 2021																																																																								
Fecha de Inicio	23 de Febrero de 2021																																																																								
Fecha de Vencimiento	Para dos años: 25 de Enero de 2023 , Para 3 años: 25 de Enero de 2024																																																																								
Fechas de Amortización:	Conforme al calendario señalado en el Anexo 1																																																																								
Periodo de Pago	El periodo existente entre cada Fecha de Inicio y Fecha Final conforme al Anexo 1																																																																								
Fecha de Revisión	Aquella que corresponda conforme al Anexo 1																																																																								
Tasa de referencia	TIEE 28 días. La Tasa de Interés Interbancaria de Equilibrio (TIEE) a 28 días, o la que la sustituya, publicada por el Banco de México publique en el Diario Oficial de la Federación en la Fecha de Revisión correspondiente a cada Periodo de Pago conforme al Anexo 1.																																																																								
Fecha de Pago	Aquella que corresponda conforme al Anexo 1																																																																								

CAP	
Parte A	Recibirá el importe que corresponda conforme a lo indicado en "Monto de Prima"
Parte B	En caso de que la tasa de referencia este por arriba del Precio de Ejercicio, La Parte A liquidará a la Parte B en cada Fecha de Pago, lo que resulte de la siguiente Formula: <i>Moto de Referencia * (Precio de Ejercicio-Tasa de Referencia)*Periodo de Pago/360</i>
Precio de Ejercicio	6.00%, 7.00%, 8.00% ó 9.00%
Acuerdo respecto de Días Hábiles	A/360, (Día hábil Siguiete Modificado)
Forma de Liquidación	Por diferenciales



 Bernardo Pablo Coindreau Pérez

Descargo de Responsabilidad

El presente documento es propiedad exclusiva de HSBC México, S.A. Institución de Banca Múltiple, Grupo Financiero HSBC, por lo que está prohibida su reproducción total o parcial sin su consentimiento previo por escrito y con la obligación de citarlo siempre como fuente con su correspondiente propiedad intelectual. Ningún elemento de este informe podrá ser reproducido, llevado o transmitido total o parcialmente a aquellos lugares, países o jurisdicciones (personas o entidades de los mismos) en los que la legislación aplicable prohíba o restrinja su distribución. El incumplimiento de esta obligación sujeta al infractor a las sanciones correspondientes. Se puede dar el evento de que HSBC México, S.A. Institución de Banca Múltiple, Grupo Financiero HSBC, sus subsidiarias, su controladora, sociedades afiliadas de ésta o sus empleados o funcionarios, tengan posiciones en valores o relaciones de negocio con los emisores de los valores mencionados en el presente documento.

©Derechos Reservados. HSBC México, S.A., Institución de Banca Múltiple, Grupo Financiero HSBC. Paseo de la Reforma No. 156. C ol. Juárez, 06600. México, D.F. 2018.

Anexo 1: Calendarios (ajustado a días hábiles):

Crédito Santander 1300 MDP				
Periodo	Fecha Inicial	Fecha Final	Disposición 1	Amortización
			Saldo	
1	23/02/2021	25/02/2021	691,030,351.90	-
2	25/02/2021	25/03/2021	690,370,845.42	\$ 659,506.48
3	25/03/2021	26/04/2021	689,703,095.11	\$ 667,750.31
4	26/04/2021	25/05/2021	689,026,997.92	\$ 676,097.19
5	25/05/2021	25/06/2021	688,342,449.52	\$ 684,548.40
6	25/06/2021	26/07/2021	687,649,344.26	\$ 693,105.26
7	26/07/2021	25/08/2021	686,947,575.19	\$ 701,769.07
8	25/08/2021	27/09/2021	686,237,034.01	\$ 710,541.18
9	27/09/2021	25/10/2021	685,517,611.06	\$ 719,422.95
10	25/10/2021	25/11/2021	684,789,195.32	\$ 728,415.74
11	25/11/2021	27/12/2021	684,051,674.39	\$ 737,520.93
12	27/12/2021	25/01/2022	683,304,934.45	\$ 746,739.94
13	25/01/2022	25/02/2022	682,548,860.26	\$ 756,074.19
14	25/02/2022	25/03/2022	681,783,335.14	\$ 765,525.12
15	25/03/2022	25/04/2022	681,008,240.95	\$ 775,094.19
16	25/04/2022	25/05/2022	680,223,458.09	\$ 784,782.86
17	25/05/2022	27/06/2022	679,428,865.44	\$ 794,592.65
18	27/06/2022	25/07/2022	678,624,340.38	\$ 804,525.06
19	25/07/2022	25/08/2022	677,809,758.76	\$ 814,581.62
20	25/08/2022	26/09/2022	676,984,994.87	\$ 824,763.89
21	26/09/2022	25/10/2022	676,149,921.43	\$ 835,073.44
22	25/10/2022	25/11/2022	675,304,409.57	\$ 845,511.86
23	25/11/2022	26/12/2022	674,448,328.82	\$ 856,080.75
24	26/12/2022	25/01/2023	673,581,547.06	\$ 866,781.76
25	25/01/2023	27/02/2023	672,703,930.52	\$ 877,616.54
26	27/02/2023	27/03/2023	671,815,343.78	\$ 888,586.74
27	27/03/2023	25/04/2023	670,915,649.70	\$ 899,694.08

28	25/04/2023	25/05/2023	670,004,709.45	\$ 910,940.25
29	25/05/2023	26/06/2023	669,082,382.44	\$ 922,327.01
30	26/06/2023	25/07/2023	668,148,526.35	\$ 933,856.09
31	25/07/2023	25/08/2023	667,202,997.06	\$ 945,529.29
32	25/08/2023	25/09/2023	666,245,648.65	\$ 957,348.41
33	25/09/2023	25/10/2023	665,276,333.38	\$ 969,315.27
34	25/10/2023	27/11/2023	664,294,901.67	\$ 981,431.71
35	27/11/2023	25/12/2023	663,301,202.07	\$ 993,699.60
36	25/12/2023	25/01/2024	662,295,081.22	\$ 1,006,120.85

Crédito 1,250 MDP Banorte				
Periodo	Fecha Inicial	Fecha Final	Disposición 1	Amortización
			Saldo	
1	23/02/2021	25/02/2021	473,397,151.13	-
2	25/02/2021	25/03/2021	472,939,265.21	\$ 457,885.92
3	25/03/2021	26/04/2021	472,475,655.71	\$ 463,609.50
4	26/04/2021	25/05/2021	472,006,251.09	\$ 469,404.62
5	25/05/2021	25/06/2021	471,530,978.91	\$ 475,272.18
6	25/06/2021	26/07/2021	471,049,765.83	\$ 481,213.08
7	26/07/2021	25/08/2021	470,562,537.59	\$ 487,228.24
8	25/08/2021	27/09/2021	470,069,219.00	\$ 493,318.59
9	27/09/2021	25/10/2021	469,569,733.92	\$ 499,485.08
10	25/10/2021	25/11/2021	469,064,005.28	\$ 505,728.64
11	25/11/2021	27/12/2021	468,551,955.03	\$ 512,050.25
12	27/12/2021	25/01/2022	468,033,504.15	\$ 518,450.88
13	25/01/2022	25/02/2022	467,508,572.64	\$ 524,931.51
14	25/02/2022	25/03/2022	466,977,079.48	\$ 531,493.16
15	25/03/2022	25/04/2022	466,438,942.66	\$ 538,136.82
16	25/04/2022	25/05/2022	465,894,079.13	\$ 544,863.53
17	25/05/2022	27/06/2022	465,342,404.81	\$ 551,674.32
18	27/06/2022	25/07/2022	464,783,834.56	\$ 558,570.25
19	25/07/2022	25/08/2022	464,218,282.18	\$ 565,552.38
20	25/08/2022	26/09/2022	463,645,660.39	\$ 572,621.79
21	26/09/2022	25/10/2022	463,065,880.83	\$ 579,779.56
22	25/10/2022	25/11/2022	462,478,854.03	\$ 587,026.80
23	25/11/2022	26/12/2022	461,884,489.39	\$ 594,364.64
24	26/12/2022	25/01/2023	461,282,695.19	\$ 601,794.20
25	25/01/2023	27/02/2023	460,673,378.57	\$ 609,316.62
26	27/02/2023	27/03/2023	460,056,445.49	\$ 616,933.08
27	27/03/2023	25/04/2023	459,431,800.75	\$ 624,644.74
28	25/04/2023	25/05/2023	458,799,347.95	\$ 632,452.80
29	25/05/2023	26/06/2023	458,158,989.49	\$ 640,358.46

30	26/06/2023	25/07/2023	457,510,626.54	\$ 648,362.95
31	25/07/2023	25/08/2023	456,854,159.06	\$ 656,467.48
32	25/08/2023	25/09/2023	456,189,485.73	\$ 664,673.33
33	25/09/2023	25/10/2023	455,516,503.99	\$ 672,981.74
34	25/10/2023	27/11/2023	454,835,109.98	\$ 681,394.01
35	27/11/2023	25/12/2023	454,145,198.54	\$ 689,911.44
36	25/12/2023	25/01/2024	453,446,663.21	\$ 698,535.33