

Términos y Condiciones

Cobertura de tasa de interés ("Cap")

Atención:

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

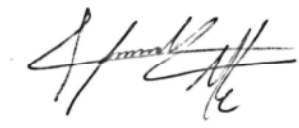
HSBC manifiesta, su intención de participar en el proceso y de acepta sujetarse a los presentes lineamientos del proceso competitivo.

Esta oferta se presenta como irrevocable y con vigencia de 24 horas.

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):	\$1,834,756,106.10 Pesos																													
Monto de Prima:	<table><tr><th>Plazo</th><th>Strike</th><th>Prima</th></tr><tr><td>2 Años</td><td>8.00%</td><td>21,741,860.00</td></tr><tr><td>2 Años</td><td>8.50%</td><td>19,576,850.00</td></tr><tr><td>2 Años</td><td>9.00%</td><td>17,769,610.00</td></tr></table>			Plazo	Strike	Prima	2 Años	8.00%	21,741,860.00	2 Años	8.50%	19,576,850.00	2 Años	9.00%	17,769,610.00	<table><tr><th>Plazo</th><th>Strike</th><th>Prima</th></tr><tr><td>3 Años</td><td>8.00%</td><td>47,153,230.00</td></tr><tr><td>3 Años</td><td>8.50%</td><td>44,657,960.00</td></tr><tr><td>3 Años</td><td>9.00%</td><td>42,309,480.00</td></tr></table>			Plazo	Strike	Prima	3 Años	8.00%	47,153,230.00	3 Años	8.50%	44,657,960.00	3 Años	9.00%	42,309,480.00
	Plazo	Strike	Prima																											
	2 Años	8.00%	21,741,860.00																											
	2 Años	8.50%	19,576,850.00																											
	2 Años	9.00%	17,769,610.00																											
Plazo	Strike	Prima																												
3 Años	8.00%	47,153,230.00																												
3 Años	8.50%	44,657,960.00																												
3 Años	9.00%	42,309,480.00																												
Fecha de celebración	17 de Enero de 2022																													
Fecha de Inicio	17 de Enero de 2022																													
Fecha de Vencimiento	Para dos años: 26 de Diciembre de 2023 , Para 3 años: 26 de Diciembre 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	TIIE 28 días. La Tasa de Interés Interbancaria de Equilibrio (TIIE) 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	8.00%, 8.50% ó 9.00%
Acuerdo respecto de Días Hábles	A/360, (Día hábil Siguiente Modificado)
Forma de Liquidación	Por diferenciales



Firma Representante Legal
Edgardo Garcia Martínez

Anexo 1: Calendarios (ajustado a días hábiles):

Fecha de Inicio	Fecha de Vencimiento	Fecha de Pago	Monto
17/01/2022	25/01/2022	25/01/2022	1,834,756,106.10
25/01/2022	25/02/2022	25/02/2022	1,834,756,106.10
25/02/2022	25/03/2022	25/03/2022	1,834,756,106.10
25/03/2022	25/04/2022	25/04/2022	1,834,756,106.10
25/04/2022	25/05/2022	25/05/2022	1,834,756,106.10
25/05/2022	27/06/2022	27/06/2022	1,834,756,106.10
27/06/2022	25/07/2022	25/07/2022	1,834,756,106.10
25/07/2022	25/08/2022	25/08/2022	1,834,756,106.10
25/08/2022	26/09/2022	26/09/2022	1,834,756,106.10
26/09/2022	25/10/2022	25/10/2022	1,834,756,106.10
25/10/2022	25/11/2022	25/11/2022	1,834,756,106.10
25/11/2022	26/12/2022	26/12/2022	1,834,756,106.10
26/12/2022	25/01/2023	25/01/2023	1,834,756,106.10
25/01/2023	27/02/2023	27/02/2023	1,834,756,106.10
27/02/2023	27/03/2023	27/03/2023	1,834,756,106.10
27/03/2023	25/04/2023	25/04/2023	1,834,756,106.10
25/04/2023	25/05/2023	25/05/2023	1,834,756,106.10
25/05/2023	26/06/2023	26/06/2023	1,834,756,106.10
26/06/2023	25/07/2023	25/07/2023	1,834,756,106.10
25/07/2023	25/08/2023	25/08/2023	1,832,513,498.37
25/08/2023	25/09/2023	25/09/2023	1,830,241,736.74
25/09/2023	25/10/2023	25/10/2023	1,827,940,442.21
25/10/2023	27/11/2023	27/11/2023	1,825,609,230.86
27/11/2023	26/12/2023	26/12/2023	1,823,247,713.75
26/12/2023	25/01/2024	25/01/2024	1,820,855,496.92
25/01/2024	26/02/2024	26/02/2024	1,818,432,181.27
26/02/2024	25/03/2024	25/03/2024	1,815,977,362.52
25/03/2024	25/04/2024	25/04/2024	1,813,490,631.12
25/04/2024	27/05/2024	27/05/2024	1,810,971,572.22
27/05/2024	25/06/2024	25/06/2024	1,808,419,765.55
25/06/2024	25/07/2024	25/07/2024	1,805,834,785.40
25/07/2024	26/08/2024	26/08/2024	1,803,216,200.50
26/08/2024	25/09/2024	25/09/2024	1,800,563,574.00
25/09/2024	25/10/2024	25/10/2024	1,797,876,463.35
25/10/2024	25/11/2024	25/11/2024	1,795,154,420.27
25/11/2024	26/12/2024	26/12/2024	1,792,396,990.62