



Confirmación de Operación de Opción de Tasa

Operación No. CAP-3428-MX39544639

De: BBVA BANCOMER SA INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,
GRUPO FINANCIERO BBVA BANCOMER
Av. Paseo de la Reforma No. 510
Col. Juárez Del. Cuauhtémoc, CP 06600
Ciudad de México Tel. 5621-9572

PARA: ESTADO DE YUCATAN
ATENCION: OLGA ROSAS MOYA / ROBERTO SUAREZ COLDWEL / PEDRO OMAR PATRON BALLOTE

Confirmamos la Operación de Opción que realizamos con ustedes en los siguientes términos, con la presente Confirmación No. CAP-3428-MX39544639 emitida al amparo del Contrato Marco para Operaciones Financieras Derivadas No. 3428 celebrado el 24 de enero de 2018 entre las partes que se señalan a continuación como Comprador y Vendedor. Salvo que se definan en la presente de cualquier otra manera, los términos que inician con mayúscula tendrán el significado que se lista en los documentos antes mencionados.

Comprador: ESTADO DE YUCATAN
Vendedor: BBVA BANCOMER SA INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO BBVA BANCOMER

Tipo de opción: Opción de Compra

Tipo de ejercicio: Europea

Activo Subyacente: TIIE

Fecha de Celebración de la Operación: 26 de febrero de 2021

Margen: 0.00

Plazo		Monto de Referencia MXN	Fecha de Ejercicio	Fecha de Liquidación
Fecha de Inicio	Fecha de Terminación			
01/03/2021	29/03/2021	1,376,870,842.04	26/02/2021	29/03/2021
29/03/2021	28/04/2021	1,375,889,601.02	26/03/2021	28/04/2021
28/04/2021	28/05/2021	1,374,896,094.07	27/04/2021	28/05/2021
28/05/2021	28/06/2021	1,373,890,169.32	27/05/2021	28/06/2021
28/06/2021	29/07/2021	1,372,871,669.37	25/06/2021	29/07/2021
29/07/2021	30/08/2021	1,371,840,438.21	28/07/2021	30/08/2021
30/08/2021	28/09/2021	1,370,796,317.06	27/08/2021	28/09/2021
28/09/2021	28/10/2021	1,369,739,144.38	27/09/2021	28/10/2021
28/10/2021	29/11/2021	1,368,668,757.24	27/10/2021	29/11/2021
29/11/2021	28/12/2021	1,367,584,989.97	26/11/2021	28/12/2021
28/12/2021	28/01/2022	1,366,487,675.50	27/12/2021	28/01/2022
28/01/2022	28/02/2022	1,365,376,645.40	27/01/2022	28/02/2022

Precio de Ejercicio: 6.0 %

Prima y Moneda de pago de la Prima: 131,745.94 MXN

Fecha de Inicio: 01 de marzo de 2021

Fecha de Pago de la Prima: 02 de marzo de 2021

Fecha de Vencimiento: 28 de febrero de 2022

Forma de Liquidación:

Diferenciales, de acuerdo a la siguiente fórmula

CAP-3428-MX39544639



$$\text{Diferencia} = \text{Max} [0, (\text{VR} - \text{PE}) * (\text{ND} / 360)] * \text{N}$$

Donde:

PE: Precio de Ejercicio

VR: Valor de Referencia

ND: Número de días entre el Periodo de Ejercicio y La Fecha de Liquidación

N: Monto de Referencia

Fuente:

"TASA TIIE" significa, la tasa de interés interbancaria de equilibrio a plazo de 28 días, que da a conocer el Banco de México en su página de internet www.banxico.org.mx

Finalidad de la Operación para BBVA Bancomer S.A.: Especulación (X) Cobertura ()

Finalidad de la Operación ESTADO DE YUCATAN:

Especulación () Cobertura (X)

Cuentas:

Banco: BBVA BANCOMER SA

Beneficiario: SECRETARIA DE ADMINISTRACION Y FINANZAS

Cuenta: 0189531645

De conformidad con el Contrato Marco, agradeceremos que cualquier aclaración u observación en relación con la Operación que aquí se confirma nos la hagan llegar por escrito dentro del Día Hábil siguiente a la fecha de recepción de la presente Confirmación. En caso de no recibir observación alguna de su parte dentro del plazo antes señalado, la Operación y los términos consignados en la presente Confirmación se tendrán ratificados y aceptados tácitamente por ustedes.

ESTADO DE YUCATAN manifiesta que, según su leal saber y entender, la posición media en derivados extrabursátiles de todas las entidades pertenecientes a su grupo, calculada al final de cada mes, durante los 12 meses inmediatamente anteriores, en términos de importe nominal bruto, no excede ninguno de los siguientes umbrales:

- (a) 1,000 millones EUR para los derivados de crédito;
- (b) 1,000 millones EUR para los derivados de renta variable;
- (c) 3,000 millones EUR para los derivados de tipos de interés;
- (d) 3,000 millones EUR para los derivados de divisas; ni
- (e) 3,000 millones EUR para otros derivados no especificados en las letras a) a d).

A la hora de realizar los cálculos anteriores, no se incluirán en el cómputo:

- (a) los contratos de derivados extrabursátiles que tengan finalidad de cobertura, entendiéndose que tienen finalidad de cobertura aquellos derivados extrabursátiles que reduzcan de una manera objetivamente mensurable los riesgos relacionados directamente con la actividad comercial o la actividad de financiación de tesorería de las entidades del grupo.
- (b) los derivados que puedan tener empresas del grupo que sean: (i) empresas que presten servicios de inversión; (ii) entidades de crédito; (iii) empresas de seguros; (iv) empresas de reaseguros; (v) organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios o su sociedad de gestión; (vi) fondos de pensiones de empleo; (vii) fondos de inversión alternativo; o (viii) depositarios centrales de valores.

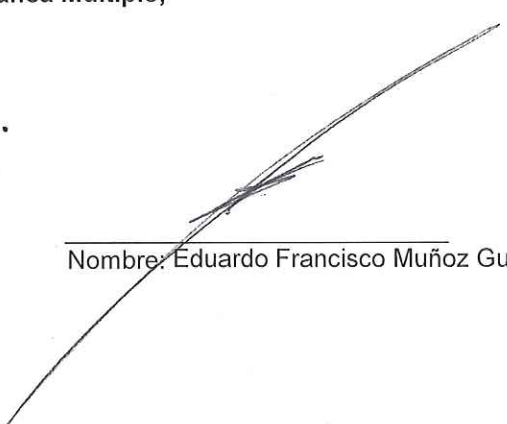
CAP-3428-MX39544639



Ciudad de México, a 26 de febrero de 2021

BBVA Bancomer, S.A., Institución de Banca Múltiple,
Grupo Financiero BBVA Bancomer


Nombre: M. Alejandro Félix Pérez


Nombre: Eduardo Francisco Muñoz Guzmán

De conformidad:

ESTADO DE YUCATAN

Nombre: _____


Nombre: _____

CAP-3428-MX39544639



Favor de contactarnos para mayor información o aclaraciones sobre la presente operación en referencia a:

Términos y Condiciones

Middle Office Liberación
mo_liberacion@bbva.com

y

Oscar Pérez Tinajero
oscar.perez@bbva.com
(525) 55 5621 9935

Liquidaciones

Back Office Prematch
bo_prematch.group@bbva.com

y

Diego Alejandro Delgado Duran
diegoalejandro.delgado.duran@bbva.com
(525) 5621 9872

Confirmaciones Escritas

Middle Office Documentación
middleofficedoc.group@bbva.com

y

Karla Gabriela García Gerardo
karlagabriela.garcia@bbva.com
(525) 5621 9572

Agradeceremos enviar su confirmación firmada en original a la siguiente dirección:

Middle Office Documentación

Av. Paseo de la Reforma No. 510 piso 18
Col. Juárez, Delegación Cuauhtémoc
C.P. 06600, Ciudad de México, México

En atención a: Karla Gabriela García Gerardo