

Julio Obregón Tirado
Indeval S.A.

Av. Paseo de la Reforma No. 255
Col. Cuauhtémoc, C.P. 06500,
Ciudad de México

En relación a la emisión de títulos opcionales de compra **XLF006R DC016** con serie **366** comunico que el día de hoy tiene observación dicha emisión con **200,000** títulos en circulación.

En su PRIMERA y UNICA fecha de observación PAGA Y VENCE.

Derecho de Pago y Derecho de Ejercicio		
Precio Ejercicio	\$1,000.00	<p>I. Si el Valor de Referencia de Ejercicio del Título Opcional, en la Fecha de Ejercicio es mayor o igual al Precio de Ejercicio multiplicado por el Factor 8, la emisora pagará:</p> $[(PE*F6) + (PRPE*F5)]$ <p>II. Si el Valor de Referencia de Ejercicio del Título Opcional, en la Fecha de Ejercicio es menor al Precio de Ejercicio multiplicado por el Factor 8 y mayor o igual al Precio de Ejercicio multiplicado por el Factor 3, la emisora pagará:</p> $[(VE - (PE*F3)) * (F1) + (PE*F1) + (PRPE*F5)]$ <p>III. Si el Valor de Referencia de Ejercicio del Título Opcional, en la Fecha de Ejercicio es menor al Precio de Ejercicio multiplicado por el Factor 3 y mayor o igual al Precio de Ejercicio multiplicado por el Factor 2, la emisora pagará:</p> $[(PE*F1) + (PRPE*F5)]$ <p>IV. Si el Valor de Referencia del Título Opcional, en la Fecha de Ejercicio es menor al Precio de Ejercicio multiplicado por el Factor 2 y mayor al Precio de Ejercicio multiplicado por el Factor 9, la emisora pagará:</p> $[(VE - (PE*F2)) * (F7) + (PE*F1) + (PRPE*F5)]$ <p>IV. Si el Valor de Referencia de Ejercicio del Título Opcional, en la Fecha de Ejercicio es menor o igual al Precio de Ejercicio multiplicado por el Factor 9, la emisora pagará:</p> $[(PE*F4) + (PRPE*F5)]$ <p>La diferencia entre el Valor de Referencia de Ejercicio y el Precio de Ejercicio no podrá tener un valor "superior o "inferior" al Porcentaje "Máximo" o "Mínimo" de Ejercicio calculado sobre el Precio de Ejercicio.</p> <p>Dónde: VE = Valor de Referencia de ejercicio. PE = Precio de Ejercicio. PRPE = Porcentaje Retornable de la Prima de Emisión</p>
Rendimiento Máximo del Título Opcional	21.97% = \$219.70 MN	
Porcentaje Retornable de la Prima	100.00% = \$1,000.00 MN	
Rendimiento Máximo del Derecho	21.97%	
Precio de Cierre del Mercado Origen de XLF* del día 12 de Junio de 2020 x (1000/Precio de Cierre del Mercado de Origen de XLF* del día 10 de Mayo de 2019	\$ 27.48 USD	
Factor 1	1.000000	
Factor 2	0.980000	
Factor 3	1.020000	
Factor 4	1.100000	
Factor 5	0.000000	
Factor 6	1.100000	
Factor 7	-1.000000	
Factor 8	1.120000	
Factor 9	0.760200	
Valor de Referencia de Ejercicio	Precio de Cierre del Mercado Origen de XLF* del día 12 de Junio de 2020 x (1000/Precio de Cierre del Mercado de Origen de XLF* del día 10 de Mayo de 2019	

Nivel de Cierre: **XLF*** \$ **23.83 USD**

Por lo Tanto:

Valor Intrínseco \$ **112.82 pesos**
Liquidación por Título: \$ **1,112.82 pesos**
Liquidación Total: \$ **222,564,000.00 pesos**

Fecha de Liquidación: **16 – JUNIO – 2020**

ATENTAMENTE

Renata Meza Arana
Equity Derivatives

Citibanamex Casa de Bolsa, S.A. de C.V., Casa de Bolsa, Integrante del Grupo Financiero Citibanamex