

AVISO DE OFERTA PÚBLICA



CITIBANAMEX CASA DE BOLSA, S.A. DE C.V., CASA DE BOLSA, INTEGRANTE DEL GRUPO FINANCIERO CITIBANAMEX

OFERTA PÚBLICA DE HASTA 34,710 (TREINTA Y CUATRO MIL SETECIENTOS DIEZ) TÍTULOS OPCIONALES COMPRA, EN EFECTIVO, EUROPEOS, CON RENDIMIENTO LIMITADO, CON PORCENTAJE RETORNABLE DE LA PRIMA DE EMISIÓN, REFERIDOS A TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING, DIVIDIDA HASTA EN 1,000 (MIL) SERIES, A EMITIRSE EN COLOCACIONES SUBSECUENTES, DE CONFORMIDAD CON LOS TÉRMINOS Y CONDICIONES DEL ACTA DE EMISIÓN, CONTENIDA EN LA ESCRITURA PÚBLICA NÚMERO 63,660, DE FECHA 28 DE MAYO DE 2015, OTORGADA ANTE LA FE DEL LICENCIADO JOSÉ MANUEL GÓMEZ DEL CAMPO LÓPEZ, TITULAR DE LA NOTARÍA PÚBLICA NÚMERO 136 DE LA CIUDAD DE MÉXICO, SEGÚN LA MISMA HA SIDO MODIFICADA MEDIANTE PRIMERA MODIFICACIÓN, CON FECHA 18 DE MAYO DE 2016 CONTENIDA EN LA ESCRITURA PÚBLICA 64,889 OTORGADA ANTE LA FE DEL LICENCIADO JOSÉ MANUEL GÓMEZ DEL CAMPO LÓPEZ, TITULAR DE LA NOTARÍA PÚBLICA NÚMERO 136 DE LA CIUDAD DE MÉXICO Y MEDIANTE SEGUNDA MODIFICACIÓN, CON FECHA 10 DE MAYO DE 2017 CONTENIDA EN LA ESCRITURA PÚBLICA NÚMERO 65,942 OTORGADA ANTE LA FE DEL LICENCIADO ADRIÁN ROGELIO ITURBE GALINDO, TITULAR DE LA NOTARÍA PÚBLICA NÚMERO 139 DE LA CIUDAD DE MÉXICO Y MEDIANTE TERCERA MODIFICACIÓN, CON FECHA 4 DE MAYO DE 2018 CONTENIDA EN LA ESCRITURA PÚBLICA NÚMERO 83,062 OTORGADA ANTE LA FE DEL LICENCIADO JOSÉ ROBERTO NUÑEZ Y BANDERA, TITULAR DE LA NOTARÍA PÚBLICA NÚMERO 1 DE LA CIUDAD DE MÉXICO.

LOS TÍTULOS OPCIONALES SE EMITEN EN LOTES DE 10 (DIEZ) TÍTULOS OPCIONALES CADA UNO.

MONTO TOTAL DE LA OFERTA

\$ 34,710,000.00

(TREINTA Y CUATRO MILLONES SETECIENTOS DIEZ MIL PESOS CON 00/100 M.N.)

| Fechas de la presente Colocación:  |  |
|--|--|
| Fecha de la Oferta de la Serie:  | 30 de Marzo de 2021  |
| Fecha de Cierre del Libro de la Serie:   | 30 de Marzo de 2021  |
| Fecha de Emisión de la Serie:  | 30 de Marzo de 2021  |
| Fecha de Publicación del Aviso de Colocación con Fines Informativos de la Serie: | 30 de Marzo de 2021  |
| Fecha de Cruce:  | 30 de Marzo de 2021  |
| Fecha de Liquidación:  | 31 de Marzo de 2021  |
| Fecha de Registro en Bolsa:  | 30 de Marzo de 2021  |
| Plazo de Vigencia de la Serie:   | El plazo de vigencia de esta Serie es de 545 días, sin exceder el Plazo de Vigencia de la Emisión. |

| Características de la presente Colocación:      |  |
|---|--|
| Monto Emitido:                                  | \$34,710,000.00 (Treinta Y Cuatro Millones Setecientos Diez Mil pesos con 00/100 M.N.) |
| Monto Colocado:                                 | \$34,710,000.00 (Treinta Y Cuatro Millones Setecientos Diez Mil pesos con 00/100 M.N.) |
| Número de Títulos Opcionales:                   | 34,710 Títulos Opcionales.   |
| Clase de Títulos:                               | Títulos Opcionales de Compra   |
| Forma de Liquidación:                           | En efectivo  |
| Tipo de Ejercicio:                              | Europeo  |
| Fecha(s) de Observación:                        | No aplica.   |
| Fecha(s) de Ejercicio:                          | 26 de Septiembre de 2022   |
| Volumen Mínimo de Títulos Opcionales a Ejercer: | Un Lote.   |

| Activo(s) Subyacentes sobre el (los) que se emiten los Títulos Opcionales: |                  |                 |   |                         |
|--|------------------|-----------------|---|-------------------------|
| Activo(s) Subyacente(s)  | Clave de Pizarra | Clave Bloomberg | Nivel de Referencia del(os) Activo(s) Subyacente(s) | Mercado de Origen       |
| TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING   | TSM N            | TSM UN EQUITY   | \$ 108.96 USD                                       | New York Stock Exchange |

| Nivel de Referencia:   |   |
|--|---|
| Nivel de Referencia del Título Opcional en la Fecha Inicial: | 108.96 MXN*(1,000.00/108.96 MXN) = 1,000.00   |
| Nivel de Referencia del Título Opcional:                     | Precio de Cierre del Mercado Origen de TSM N x (1000/Precio de Cierre del Mercado de Origen de TSM N del día 24 de Marzo de 2021) |

| Gastos Relacionados con la Colocación:   |  |
|--|--|
| Registro RNV:  | \$17,355.00 (Diecisiete Mil Trescientos Cincuenta Y Cinco pesos con 00/100 M.N.) |
| Listado en BMV:  | \$15,002.22 (Quince Mil Dos pesos con 22/100 M.N.)                               |
| Representante Común:   | Value, S.A. de C.V., Casa de Bolsa, Value Grupo Financiero                       |
| Todos los gastos relacionados con la colocación fueron cubiertos con recursos propios de la Emisora. |  |

| Recursos netos que obtendrá la Emisora por la Colocación: |  |
|---|--|
| Recursos netos:   | \$34,677,642.78 (Treinta Y Cuatro Millones Seiscientos Setenta Y Siete Mil Seiscientos Cuarenta Y Dos pesos con 78/100 M.N.) |

| Información de la Emisión:                                 |  |
|--|--|
| Emisora:   | Citibanamex Casa de Bolsa, S.A. de C.V., Casa de Bolsa, integrante del Grupo Financiero Citibanamex.   |
| Agente Colocador Líder:                                    | Citibanamex Casa de Bolsa, S.A. de C.V., Casa de Bolsa, integrante del Grupo Financiero Citibanamex.   |
| Lugar de Emisión:  | Ciudad de México   |
| Plazo de la Vigencia de la Emisión:                        | Hasta 10 años contados a partir de la fecha del Acta de Emisión  |
| Número de Títulos Opcionales autorizados para circular:    | Hasta 100,000,000 (cien millones) de Títulos Opcionales  |
| Posibles Adquirentes de todas y cada una de las series:    | Personas Físicas Morales, nacionales y extranjeras, cuando su régimen de inversión lo prevea expresamente.   |
| Régimen Fiscal Aplicable a todas y cada una de las Series: | El tratamiento fiscal respecto de los ingresos que en su caso, generen los Títulos Opcionales se registrará para personas físicas y morales residentes en México, por lo previsto en los artículos 16-A y 16-C del Código Fiscal de la Federación, así como en los artículos 20, 28 fracción XVII, 129, 142 fracción XIV, 146, 161, 163 de la LISR vigente, así como los artículos 15, 271, y 289 del Reglamento del mismo ordenamiento, y otras disposiciones complementarias.<br>El régimen fiscal podrá modificarse a lo largo de la vigencia por lo que los posibles adquirentes de los Títulos Opcionales deberán consultar con sus asesores las consecuencias fiscales resultantes de las operaciones que pretendan llevar a cabo, incluyendo la aplicación de reglas específicas respecto de su situación en particular.  |
| Lugar y Forma de Liquidación:                              | En la S.D. Indeval Institución para el Depósito de Valores, S.A. de C.V., mediante transferencia electrónica.  |
| Evento Extraordinario                                      | Por Evento Extraordinario, se entenderá (i) el hecho de que dejen de existir, se cancele o suspenda la cotización en el Mercado de Origen de los Activos Subyacentes que representen individualmente o en su conjunto más del 30% (treinta por ciento) del valor de mercado de los Activos Subyacentes; (ii) el hecho de que dejen de existir, se cancele o suspenda la cotización en el Mercado de Origen de las acciones que representen individualmente o en su conjunto más del 30% (treinta por ciento) del valor de mercado del Índice en caso de que los Activos Subyacentes sean índices de precios accionarios; (iii) en caso de que los Emisores de los Activos Subyacentes dejen de proporcionar al público información de los Activos Subyacentes; (iv) en caso los Activos Subyacentes dejen de estar listados en el Sistema Internacional de Cotizaciones, en caso de que se encuentren listados en dicho sistema; o (v) en caso de que exista un cambio en la regulación vigente (incluyendo las disposiciones fiscales aplicables) que incrementen de manera significativa los costos incurridos en la Cobertura de los títulos opcionales o en su defecto prohíban la adquisición de dicha Cobertura. |
| Efecto del Activo Subyacente sobre los Títulos Opcionales: | El valor de los Títulos opcionales se podría ver afectado por el nivel de mercado del Activo Subyacente, tasas de interés, la volatilidad implícita y el plazo o vencimiento. El movimiento de dichas variables depende de diversos factores ajenos a la Emisora.  |

| Serie | Clave de Pizarra de esta serie | Prima de Emisión | Porcentaje Retornable de la Prima | Rendimiento Máximo del Título Opcional | Factor Monetario Inicial | Precio por Lote |
|-------|--------------------------------|------------------|-----------------------------------|--|--------------------------|-----------------|
| 541   | TSM209R DC002                  | \$1,000.00       | 70.00%<br>\$ 700.00 M.N.          | 27.80%<br>\$ 278.00 M.N.               | N/A                      | \$10,000.00     |

| Factor 1 | Factor 2 | Factor 3 | Factor 4 | Factor 5 | Factor 6 |
|----------|----------|----------|----------|----------|----------|
| 1.0000   | 1.1200   | 0.8500   | 0.0000   | 1.27800  | 0.7000   |

|  |   |
|--|---|
| Fuente de consulta de información                  | La información de TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING, se puede consultar en la siguiente página electrónica en la red mundial (Internet): <a href="http://www.tsmc.com.tw">www.tsmc.com.tw</a> .  |
| Descripción del activo subacente y datos generales | Taiwan Semiconductor Manufacturing Company, Ltd fabrica y comercializa circuitos integrados. Ofrece los siguientes servicios: fabricación y prueba de obleas, ensamblaje y ensayos, producción de máscaras y servicios de diseño. Sus CI se usan en ordenadores, comunicación, artículos electrónicos de consumo, automotores e empresas de equipo industrial |
| Suspensión de negociación                          | No se tiene registrada suspensión alguna por los últimos 3 ejercicios.  |
| Bolsa de valores donde son negociados los valores  | New York  |

Los Títulos Opcionales son documentos que representan un derecho temporal adquirido por los Tenedores a cambio del pago de una Prima de Emisión. El Precio de Mercado del Título Opcional en el mercado secundario puede variar en función del Nivel de Mercado de los Activos Subyacentes que lo compongan. Cada Título Opcional otorga a su Tenedor el derecho de ejercicio conforme a lo siguiente:

| Derecho                           |  | <p>I. Si el valor de Referencia de Ejercicio del Título Opcional, en la Fecha de Ejercicio es mayor al precio de ejercicio multiplicado por el Factor 5, la emisora pagará:</p> $[(PE * \text{Factor } 5) + (PRPE * \text{Factor } 4)]$ <p>II. Si el Valor de Referencia de Ejercicio del Título Opcional, en la Fecha de Ejercicio es mayor al precio de Ejercicio multiplicado por el Factor 2 y menor o igual al precio de ejercicio multiplicado por el Factor 5, la emisora pagará:</p> $((VE - (PE * \text{Factor } 1)) * (\text{Factor } 1) + (PE * \text{Factor } 1) + (PRPE * \text{Factor } 4))$ <p>III. Si el Valor de Referencia de Ejercicio del Título Opcional, en la Fecha de Ejercicio es mayor al precio de Ejercicio multiplicado por el Factor 3 y menor o igual al precio de ejercicio multiplicado por el Factor 2, la emisión pagará:</p> $(PE * F2) + (PRPE * F4)$ <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 3 y mayor o igual al Precio de Ejercicio multiplicado por el Factor 6, la emisora pagará:</p> $((VE - (PE * \text{Factor } 1)) * \text{Factor } 1) + (PE * \text{Factor } 1) + (PRPE * \text{Factor } 4)$ <p>V. 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 6, la Emisora pagará:</p> $((PE * \text{Factor } 6) + (PRPE * \text{Factor } 4))$ <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> |
|-----------------------------------|--|---|
| Fecha de Ejercicio                | 26 de Septiembre de 2022   |   |
| Precio de Ejercicio               | \$1,000.00   |   |
| Porcentaje Máximo de Ejercicio    | 27.800%  |   |
| Porcentaje Mínimo de Ejercicio    | -30.000%   |   |
| Factor Monetario Final            | N/A  |   |
| Fecha de Liquidación de Ejercicio | 28 de Septiembre de 2022   |   |
| Valor de Referencia de Ejercicio  | Precio de Cierre del Mercado Origen de TSM N del día 26 de Septiembre de 2022 x (1000/Precio de Cierre del Mercado de Origen de TSM N del día 24 de Marzo de 2021) |   |

Los Títulos Opcionales de Compra o de Venta en Efectivo Americanos o Europeos, en su caso con Rendimiento Limitado, con o sin Porcentaje Retornable de la Prima de Emisión objeto de esta Emisión, son instrumentos financieros diseñados para inversionistas conocedores de dichos instrumentos, así como de los factores que determinan su precio. El adquirente debe conocer los riesgos que asume en caso de un Evento Extraordinario y que se mencionan en el Acta de Emisión y en el Prospecto de Colocación. Cada serie de Títulos Opcionales está representada por un Título depositado en la S.D. Ineval Institución para el Depósito de Valores, S.A. de C.V.

Salvo que se indique lo contrario en el Aviso de Oferta Pública respectivo, los Títulos Opcionales objeto de la presente Emisión y la Emisora cumplen con las políticas de diversificación mencionadas en el artículo 6 de las disposiciones de carácter general aplicables a las entidades financieras y demás personas que proporcionen servicios de inversión emitidas por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores.

Agente Colocador



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

Los Títulos Opcionales objeto de la presente oferta se encuentran inscritos en el RNV con el número 0559-1.20-2015-073 y se listarán en la Bolsa Mexicana de Valores S.A.B. de C.V. La presente Emisión de Títulos Opcionales y su oferta pública fue autorizada por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores mediante oficio No. 153/5348/2015 de fecha 26 de mayo de 2015, 153/105543/2016 de fecha 11 de mayo de 2016 y 153/10284/2017 de fecha 4 de mayo de 2017 y 153/11724/2018 de fecha 3 de mayo de 2018 relativos a la primera, segunda y tercera actualización de inscripción en el RNV, respectivamente. La inscripción en el RNV no implica certificación sobre la bondad de los valores, solvencia del Emisor o sobre la exactitud o veracidad de la información contenida en el Prospecto, ni convalida los actos que, en su caso, hubiesen sido realizados en contravención de las leyes. El presente Aviso de Oferta podrá consultarse en el portal de la BMV: [www.bmv.com.mx](http://www.bmv.com.mx), en el portal de la CNBV: [www.gob.mx/cnbv](http://www.gob.mx/cnbv), así como en el portal de la Emisora en la siguiente dirección: [www.banamex.com/sitios/casa-de-bolsa](http://www.banamex.com/sitios/casa-de-bolsa). Prospecto a disposición con el Agente Colocador en la siguiente página de Internet: [www.banamex.com/sitios/casa-de-bolsa](http://www.banamex.com/sitios/casa-de-bolsa).

Ciudad de México, a 28 de mayo de 2015.  
 Ciudad de México, a 13 de mayo de 2016.  
 Ciudad de México, a 4 de mayo de 2017.  
 Ciudad de México, a 3 de mayo de 2018.

Autorización CNBV mediante oficio número 153/5348/2015 de fecha 26 de mayo de 2015.  
 Autorización CNBV mediante oficio número 153/105543/2016 de fecha 11 de mayo de 2016.  
 Autorización CNBV mediante oficio número 153/10284/2017 de fecha 4 de mayo de 2017.  
 Autorización CNBV mediante oficio número 153/11724/2018 de fecha 3 de mayo de 2018.

Ciudad de México., a 30 de Marzo de 2021