

Ciudad de México, a 24 de junio de 2024.

Luis Enrique Flores Torres
Indeval S.A.
 Av. Paseo de la Reforma No. 255
 Col. Cuauhtémoc, C.P. 06500,
 Ciudad de México

En relación con la emisión de títulos opcionales de compra **SPY406R DC164** con serie **660** comunico que el día de hoy tiene observación dicha emisión con **22,740** 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	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: [(PE*F6)+(PRPE*F5)]
Rendimiento Máximo del Título Opcional	14.99% = \$149.90 MN	
Porcentaje Retornable de la Prima	100.00% = \$1,000.00 MN	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: [(VE-(PE*F3))*(F1)+(PE*F1)+(PRPE*F5)]
Rendimiento Máximo del Derecho	14.99%	
Precio de Cierre del Mercado Origen de SPY * del día 24 de Junio de 2024 x (1000/Precio de Cierre del Mercado de Origen de SPY * del día 23 de Junio de 2022)	\$ 378.06 USD	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: [(PE*F1)+(PRPE*F5)]
Factor 1	1.00000	
Factor 2	1.00000	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: [(VE-(PE*F2))*(F7)+(PE*F1)+(PRPE*F5)]
Factor 3	1.00000	
Factor 4	1.00000	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: [(PE*F4) +(PRPE*F5)]
Factor 5	0.00000	
Factor 6	1.30000	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. Dónde: VE = Valor de Referencia de ejercicio. PE = Precio de Ejercicio. PRPE = Porcentaje Retornable de la Prima de Emisión.
Factor 7	-1.00000	
Factor 8	1.50000	
Factor 9	0.85000	
Valor de Referencia de Ejercicio	Precio de Cierre del Mercado Origen de SPY * del día 24 de Junio de 2024 x (1000/Precio de Cierre del Mercado de Origen de SPY * del día 23 de Junio de 2022)	

Nivel de Cierre: **SPY * \$ 542.74 USD**

Por lo Tanto:
 Valor Intrínseco \$ **435.59 pesos**
 Liquidación por Título: \$ **1,435.59 pesos**
 Liquidación Total: \$ **32,645,316.60 pesos**

Fecha de Liquidación: **26 –JUNIO– 2024**

ATENTAMENTE

Renata Meza Arana
Equity Derivatives
Citibanamex Casa de Bolsa, S.A. de C.V., Casa de Bolsa, Integrante del Grupo Financiero Citibanamex