

| S-COMMV | | | | | | |
|--|--------------|---|---------|--------------------|----------------|----------|
| SCHRODERS COMMODITY, S.A. DE C.V., SOCIEDAD DE INVERSIÓN DE RENTA VARIABLE | | | | | | |
| ESPECIALIZADA EN ACCIONES DE UNA SOCIEDAD DE INVERSIÓN QUE INVIERTE EN MATERIAS PRIMAS | | | | | | |
| Tipo de Valor | Emisora | Serie / % T. I. | % T. I. | Valor Total | % | CAL/BURS |
| INVERSION EN DOLARES | | | | | | |
| CHD | 40-002 | 2624507 | | 7,704,161 | 0.81% | |
| VALORES | | | | | | |
| 56SP | LU0232506161 | LX | | 941,713,950 | 99.18% | |
| | GOLD | | 11.2 | | | |
| | BRENT CRUDE | | 7.3 | | | |
| | WTI CRUDE | | 6.9 | | | |
| | ALUMINIUM | | 5.4 | | | |
| | CORN | | 4.1 | | | |
| TOTAL CARTERA | | | | 949,418,111 | 100.00% | |
| ACTIVO NETO | | | | 948,978,416 | | |
| Cartera al: | | 02-Feb-2012 | | | | |
| LIMITE MAX. VALOR RIESGO | | 3.7800% | | | | |
| PROMEDIO | | 1.7068% | | | | |
| SUPUESTOS | | Nivel de Confianza: 95%, Observaciones: 500, Ventana de Tiempo: 1 días | | | | |
| METODOLOGIA PARA CÁLCULO | | Var Histórico | | | | |