

HSBC-DH, S. A. de C. V., Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda (HSBGOB2)

Paseo de la Reforma No. 347, Col. Cuauhtémoc, Ciudad de México

Estados de Valuación de Cartera de Inversión

31 de diciembre 2021 y 2020

Miles de pesos, excepto costos promedios unitarios de adquisición y valores razonables o contables unitarios

%	Emisora	Serie	Tipo de valor	Tasa al valorar %	Tipo de tasa (*)	Calificación o bursatilidad (**)	Cantidad de títulos	Cantidad de títulos liquidados	Total de títulos de la emisión	Costo promedio unitario de adquisición	Costo total de adquisición	Valor razonable o contable unitario	Valor razonable o contable total	Días por vencer
31 de diciembre de 2021														
62.94% Inversión en títulos de deuda														
Valores gubernamentales federales nacionales														
	BONDESD	220428	LD	5.512000	103	212	700,000	700,000	249,963,000	100.207950	\$ 70,146	100.350467	\$ 70,245	115
	BONDESD	230309	LD	5.546600	103	212	750,000	750,000	336,616,000	100.045808	75,034	100.162132	75,122	430
	BONDESD	230330	LD	5.549600	103	212	750,000	750,000	231,956,000	100.134476	75,101	100.249362	75,187	451
	BONDESD	230706	LD	5.566800	103	212	450,450	450,450	553,727,000	99.877651	44,990	99.997249	45,044	549
	BONOS	290531	M	7.459718	102	212	200,000	200,000	2,996,317,000	122.317421	24,463	106.482109	21,297	2,705
	BONOS	310529	M	7.569481	102	212	566,300	566,300	2,877,702,000	102.544522	58,071	101.739937	57,615	3,433
	BONOS	471107	M	8.059897	102	212	200,000	200,000	2,192,338,000	103.453879	20,691	99.896534	19,979	9,439
											368,496		364,489	
18.58% Deudores por reporto														
Inversión respaldada por títulos de deuda														
	BPA182	240307	IS	5.400000	104	212	1,046,902	1,046,902	286,000,000	102.206284	107,000	102.252277	107,048	-
	BONDESD	230629	LD	5.400000	103	212	1,075,727	1,075,727	428,874,000	99.984212	107,556	100.029205	107,604	-
											\$ 583,052		\$ 579,141	
31 de diciembre de 2020														
57.99% Inversión en títulos de deuda														
Valores gubernamentales federales nacionales														
	BONDESD	210915	LD	4.491600	103	241	460,000	460,000	355,266,000	100.218849	\$ 46,101	100.236995	\$ 46,109	254
	BONDESD	211007	LD	4.498500	103	241	250,000	250,000	364,276,000	100.294281	25,074	99.974540	24,994	276
	BONDESD	211118	LD	4.500000	103	241	250,000	250,000	406,477,000	100.128112	25,032	100.130759	25,033	318
	BONDESD	220428	LD	4.525400	103	241	700,000	700,000	249,963,000	100.159468	70,112	100.138505	70,097	479
	BONOS	241205	M	4.553790	102	241	620,000	620,000	2,830,553,000	114.223656	70,819	120.285035	74,577	1431
	BONOS	290531	M	5.298200	102	241	400,000	400,000	2,988,156,000	116.243884	46,498	122.317421	48,927	3069
											283,634		289,736	
42.01% Deudores por reporto														
Inversión respaldada por títulos de deuda														
	BONDESD	0	240822	LD	4.300000	103	2,108,073	2,108,073	547,583,000	99.515254	209,785	99.5628	209,886	-
											\$ 493,420		\$ 499,622	

* Tipo de tasa:
 102 Tasa fija (aplica a bonos con pagos de interés periódicos)
 103 Tasa variable (aplica a bonos con pagos de interés periódicos)
 104 Tasa real

** Calificación o bursatilidad:
 212; mxAAA; Capacidad de pago sustancialmente fuerte; SP; Local; Largo Plazo

HSBC-DH, S. A. de C. V., Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda (HSBGOB2)

Paseo de la Reforma No. 347, Col. Cuauhtémoc, Ciudad de México
Estados de Valuación de Cartera de Inversión
31 de diciembre 2021 y 2020

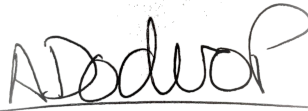
Miles de pesos, excepto costos promedios unitarios de adquisición y valores razonables o contables unitarios

Las doce notas adjuntas son parte integrante de los estados financieros.

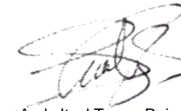
Los presentes estados de valuación de cartera de inversión, se formularon de conformidad con los criterios de contabilidad para fondos de inversión, emitidos por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores con fundamento en lo dispuesto por el artículo 76 de la Ley de Fondos de Inversión, de observancia general y obligatoria, aplicados de manera consistente, encontrándose reflejadas las operaciones con activos objeto de inversión efectuadas por el Fondo hasta las fechas arriba mencionadas, las cuales se realizaron y valoraron con apego a sanas prácticas y a las disposiciones legales y administrativas aplicables.

Los presentes estados de valuación de cartera de inversión fueron aprobados por el Consejo de Administración bajo la responsabilidad de los directivos que los suscriben.

Los presentes estados de valuación de cartera de inversión serán publicados en la página de Internet www.bmv.com.mx de conformidad con el artículo 79 de la Ley de Fondos de Inversión. En la página de Internet www.cnbv.gob.mx, la Comisión Nacional Bancaria y de Valores publica la información financiera que el Fondo le proporciona periódicamente a dicha Comisión en cumplimiento de las disposiciones de carácter general.



Antonio Dodero Portilla
Director General, HSBC Global Asset Management México



Arely Itzel Torres Rojas
Contralor Normativo, HSBC Global Asset Management México

HSBC-DH, S. A. de C. V., Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda (HSBGOB2)

Paseo de la Reforma No. 347, Col. Cuauhtémoc, Ciudad de México

Estados de Resultados

31 de diciembre de 2021 y 2020

Miles de pesos

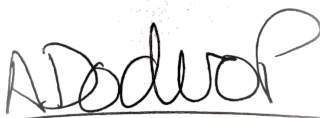
	2021	2020
Ingresos:		
Resultado por valuación a valor razonable	\$ (4,007)	\$ 6,102
Resultado por compra-venta de valores	(15,357)	(1,123)
Ingresos por intereses (Nota 5)	33,204	29,759
Ingresos totales	<u>13,840</u>	<u>34,738</u>
Egresos:		
Servicios administrativos, de operación y distribución pagados a Operadora (Notas 1 y 6)	1,242	984
Servicios administración y distribución pagados a otras entidades	363	330
Gastos de administración	5	5
Otros gastos de administración	143	131
Impuestos y derechos diversos (Nota 9)	410	380
Egresos totales	<u>2,163</u>	<u>1,830</u>
Resultado neto	<u>\$ 11,677</u>	<u>\$ 32,908</u>

Las doce notas adjuntas son parte integrante de los estados financieros.

Los presentes estados de resultados se formularon de conformidad con los criterios de contabilidad, para fondos de inversión, emitidos por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores con fundamento en lo dispuesto por el artículo 76 de la Ley de Fondos de Inversión, de observancia general y obligatoria, aplicados de manera consistente, encontrándose reflejados todos los ingresos y egresos derivados de las operaciones efectuadas por el Fondo por los años terminados en las fechas arriba mencionadas, las cuales se realizaron y valoraron con apego a sanas prácticas y a las disposiciones legales y administrativas aplicables.

Los presentes estados de resultados fueron aprobados por el Consejo de Administración bajo la responsabilidad de los directivos que los suscriben.

Los presentes estados de resultados serán publicados en la página de Internet www.bmv.com.mx de conformidad con el artículo 79 de la Ley de Fondos de Inversión. En la página de Internet www.cnbv.gob.mx, la Comisión Nacional Bancaria y de Valores publica la información financiera que el Fondo le proporciona periódicamente a dicha Comisión en cumplimiento de las disposiciones de carácter general.



Antonio Dodero Portilla
Director General, HSBC Global
Asset Management México



Arely Itzel Torres Rojas
Contralor Normativo, HSBC Global
Asset Management México

HSBC-DH, S. A. de C. V., Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda (HSBGOB2)
Paseo de la Reforma No. 347, Col. Cuauhtémoc, Ciudad de México
Estado de Variaciones en el Capital Contable
31 de diciembre de 2021 y 2020

Miles de pesos

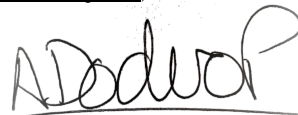
	Capital contribuido				Capital ganado			Total del capital contable
	Capital social				Prima en venta (recompra) de acciones	Resultado de ejercicios anteriores	Resultado neto	
	Autorizado			Total pagado				
Fijo	Variable	No pagado						
Saldos al 1 de enero del 2020	\$ 1,000	\$ 499,999,000	\$ (499,665,668)	\$ 6,860	\$ (721,246)	\$ 701,537	\$ 24,889	\$ 12,040
Movimientos inherentes a acuerdos de los accionistas:								
Traspaso del resultado del ejercicio anterior	-	-	-	-	-	24,889	(24,889)	-
Recompra de acciones, neto	-	-	258,363	258,363	196,132	-	-	454,496
Movimiento inherente a la operación:								
Resultado neto	-	-	-	-	-	-	32,908	32,908
Saldos al 31 de diciembre de 2020	1,000	499,999,000	(499,924,031)	265,223	(525,113)	726,426	32,908	499,444
Movimientos inherentes a acuerdos de los accionistas:								
Traspaso del resultado del ejercicio anterior	-	-	-	-	-	32,908	(32,908)	-
Recompra de acciones, neto	-	-	39,415	39,415	30,392	-	-	69,807
Movimiento inherente a la operación:								
Resultado neto	-	-	-	-	-	-	11,677	11,677
Saldos al 31 de diciembre de 2021	\$ 1,000	\$ 499,999,000	\$ (499,695,362)	\$ 304,638	\$ (494,721)	\$ 759,334	\$ 11,677	\$ 580,928

Las doce notas adjuntas son parte integrante de los estados financieros.

Los presentes estados de variaciones en el capital contable se formularon de conformidad con los criterios de contabilidad para fondos de inversión, emitidos por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores con fundamento en lo dispuesto por el artículo 76 de la Ley de Fondos de Inversión, de observancia general y obligatoria, aplicados de manera consistente, encontrándose reflejados los movimientos en las cuentas de capital contable derivados de las operaciones efectuadas por el Fondo por los años terminados en las fechas arriba mencionadas, las cuales se realizaron y valoraron con apego a sanas prácticas y a las disposiciones legales y administrativas aplicables.

Los presentes estados de variaciones en el capital contable fueron aprobados por el Consejo de Administración bajo la responsabilidad de los directivos que los suscriben.

Los presentes estados de variaciones en el capital contable serán publicados en la página de Internet www.bmv.com.mx de conformidad con el artículo 79 de la Ley de Fondos de Inversión. En la página de Internet www.cnbv.gob.mx, la Comisión Nacional Bancaria y de Valores publica la información financiera que el Fondo le proporciona periódicamente a dicha Comisión en cumplimiento de las disposiciones de carácter general.



Antonio Doderio Portilla
Director General, HSBC Global Asset Management México



Arely Itzel Torres Rojas
Contralor Normativo, HSBC Global Asset Management México