



HSBGOB2

Asset Management

HSBC-DH, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
CARTERA DE VALORES AL 11 ABRIL, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D						
LD	BONDES D	241024	mxAAA	750,000	74,983,396.50	25.40
LD	BONDES D	250220	mxAAA	450,000	45,265,152.60	15.33
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDES F	251002	mxAAA	301,130	30,263,805.90	10.25
LF	BONDES F	250619	mxAAA	200,000	20,074,888.20	6.80
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA						
M	BONOS	270603	mxAAA	700,000	67,163,052.60	22.75
M	BONOS	290301	mxAAA	225,000	21,514,736.03	7.29
OTROS TIPO DE VALOR M - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO F						
				100,000	9,071,043.60	3.07
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO MENSUAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
IM	BPAG28	251106	mxAAA	100,000	10,025,956.90	3.40
CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	240919	HR1	744,390	7,091,079.24	2.40
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					285,453,111.57	96.70
OTROS VALORES				97,476	9,750,986.54	3.30
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					295,204,098.11	100.00

CATEGORÍA
IDMPGUBCALIFICACIÓN
AAA/2 MOO

Para el fondo de Inversión HSBGOB2 cuya clasificación es de mediano plazo, el límite de Valor en Riesgo calculado mediante simulación histórica es de 0.30%, el dato observado con la cartera al 10/04/2024 es de 0.120% y el Valor en Riesgo promedio del mes en curso es de 0.121%. A esta clasificación corresponde un Valor en Riesgo al 95% de confianza, con horizonte de siete días, utilizando 500 escenarios.

ING. ANTONIO DODERO PORTILLA