



HSBC-D2

Asset Management

HSBC-D2, 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						
OTROS TIPO DE VALOR LD - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO				53,000,000	5,317,027,660.00	4.05
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDEF	250130	mxAAA	64,044,334	6,431,414,381.29	4.90
LF	BONDEF	250102	mxAAA	50,557,700	5,077,414,964.75	3.87
LF	BONDEF	250327	mxAAA	27,000,000	2,711,141,145.00	2.06
OTROS TIPO DE VALOR LF - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO				170,166,700	17,051,907,109.32	12.98
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO MENSUAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
OTROS TIPO DE VALOR IM - BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON				40,114,800	4,017,490,327.08	3.06
CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS						
OTROS TIPO DE VALOR 94 - CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS				34,912,172	3,511,384,058.88	2.67
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE BANCA DE DESARROLLO						
OTROS TIPO DE VALOR CD - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE BANCA DI				49,989,600	5,027,820,407.77	3.83
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESA				35,198,667	3,538,727,861.92	2.69
CERTIFICADOS DE DEPÓSITO						
OTROS TIPO DE VALOR F - CERTIFICADOS DE DEPÓSITO				257,500,000	25,884,613,147.50	19.71
CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
OTROS TIPO DE VALOR BI - CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FE				886,542,151	8,572,621,557.01	6.53
PAGARÉ CON RENDIMIENTO LIQUIDABLE AL VENCIMIENTO						
I	BANOBRA	24174	mxA-1+	4,114,659,979	4,098,324,778.88	3.12
I	BANOBRA	24231	mxA-1+	4,075,233,330	4,010,856,869.09	3.05
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					95,250,744,268.49	72.52
REPORTO						
LF	BONDEF	261203	mxAAA	57,062,331	5,701,360,477.17	4.34
LF	BONDEF	280323	mxAAA	47,011,053	4,687,754,375.32	3.57
IM	BPAG28	260205	mxAAA	39,379,377	3,937,875,670.46	3.00
IQ	BPAG91	280511	mxAAA	38,588,639	3,910,357,432.69	2.98
IS	BPA182	301010	mxAAA	36,644,981	3,844,081,682.01	2.93
LF	BONDEF	270225	mxAAA	27,500,000	2,746,012,253.59	2.09
TOTAL REPORTO					24,827,441,891.24	18.90
OTROS VALORES				119,058,166	11,262,394,706.99	8.58
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					131,340,580,866.72	100.00

CATEGORÍA
IDCPCALIFICACIÓN
AAA/1 MOO

Para el fondo de Inversión HSBC-D2 cuya clasificación es de corto plazo, el límite de Valor en Riesgo calculado mediante simulación histórica es de 0.04%, el dato observado con la cartera al 10/04/2024 es de 0.006% y el Valor en Riesgo promedio del mes en curso es de 0.006%. A esta clasificación corresponde un Valor en Riesgo al 95% de confianza, con horizonte de un día, utilizando 500 escenarios.

ING. ANTONIO DODERO PORTILLA