

Asset Management

HSBC-D2

HSBC-D2, S.A. DE C.V. Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda. CARTERA DE VALORES AL 25 ABRIL, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DE	SARROLLO DEL GOB	IERNO FEDERAL BONDES	S D			
OTROS TIPO DE	VALOR LD - BONOS DE	DESARROLLO DEL GOBIER	NO	40,000,000	4,011,239,660.00	3.02
BONOS DE DE	SARROLLO DEL GOB	IERNO FEDERAL BONDES	F			
LF	BONDESF	250130	mxAAA	64,044,334	6,402,090,786.35	4.82
LF	BONDESF	250102	mxAAA	50,557,700	5,054,282,188.00	3.81
LF	BONDESF	250327	mxAAA	27,000,000	2,699,026,515.00	
		DESARROLLO DEL GOBIER		175,166,700	17,543,397,103.39	13.22
			DE INTERÉS Y TASA DE INTER	RÉS DE REFERENCIA ADIC	CIONAL	
OTROS TIPO DE	VALOR IM - BONOS DE	PROTECCIÓN AL AHORRO	CON	40,114,800	4,012,397,818.64	3.02
	S BURSÁTILES BANC					
		DOS BURSÁTILES BANCARIO	OS	37,912,172	3,809,031,452.98	3 2.87
CERTIFICADO	S BURSÁTILES DE BA	NCA DE DESARROLLO				
		ADOS BURSÁTILES DE BANC	A DI	49,989,600	5,022,597,554.85	3.78
	S BURSÁTILES DE EM					
OTROS TIPO DE	VALOR 91 - CERTIFICA	DOS BURSÁTILES DE EMPRI	ESA	33,198,667	3,335,043,062.22	2.51
CERTIFICADO	S DE DEPÓSITO					
OTROS TIPO DE	VALOR F - CERTIFICAD	OOS DE DEPÓSITO		257,500,000	25,840,974,377.50	19.47
CERTIFICADO	S DE LA TESORERIA D	DE LA FEDERACIÓN CON I	MPUESTO			
OTROS TIPO DE VALOR BI - CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FE				886,542,151	8,607,847,439.18	6.48
PAGARÉ CON	RENDIMIENTO LIQUID	DABLE AL VENCIMIENTO				
I	BANOBRA	24231	mxA-1+	4,075,233,330	4,027,985,074.77	3.03
I	BANOBRA	24261	mxA-1+	4,074,000,014	4,000,399,129.75	3.01
TOTAL INVERS	SIONES EN DIRECTO				94,366,312,162.63	71.09
REPORTO						
LF	BONDESF	280127	mxAAA	54.150.974	5.379.109.591.21	4.05
LF	BONDESF	250619	mxAAA	53,150,189	5,304,827,036,49	
LF	BONDESF	280323	mxAAA	47.011.053	4.666.357.553.70	
IQ	BPAG91	270107	mxAAA	36,900,181	3,695,231,038.57	
IS	BPA182	301010	mxAAA	36.644.981	3,644,609,991,17	
LF	BONDESF	290419	mxAAA	35,259,490	3,493,461,802.46	
TOTAL REPOR		*****		,,100	26,183,597,013.60	
OTROS VALOR	DES.		·	115,944,270	12,192,574,088.80	9.19
OTROS VALOR	\LU			115,944,270	12, 192, 574, 000.00	9.19
TOTAL DE INV	ERSIONES EN VALOR	ES			132,742,483,265.03	3 100.00

CATEGORÍA CALIFICACIÓN IDCP 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 24/04/2024 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