



HSBCCOR

Asset Management

HSBC-D1, 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 CON TASA DE INTERÉS FIJA						
M	BONOS	270603	mxAAA	2,900,000	278,246,932.20	7.63
M	BONOS	290301	mxAAA	1,390,900	132,999,317.05	3.65
CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS						
94	BSMX	19-2	AAA.mx	990,000	97,166,184.39	2.67
94	BACOMER	19-2	AAA.mx	1,000,000	97,116,143.00	2.66
OTROS TIPO DE VALOR 94 - CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS				1,750,000	175,773,120.50	4.82
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE BANCA DE DESARROLLO						
CD	BANOB	21-2X	mxAAA	2,500,000	252,041,402.50	6.91
CD	BACMEXT	21-2	mxAAA	2,500,000	251,958,020.00	6.91
CD	KEXIM	21	AAA.mx	1,800,000	181,855,587.60	4.99
OTROS TIPO DE VALOR CD - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE BANCA DI				1,439,200	135,239,626.76	3.71
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
91	FUNO	15	AAA(mex)	1,269,918	121,634,775.37	3.34
91	BBVALMX	18-2	AAA(mex)	1,110,000	111,080,321.82	3.05
91	GAP	20	mxAAA	832,793	83,562,616.18	2.29
OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESA				8,437,301	815,941,408.03	22.38
CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
OTROS TIPO DE VALOR BI - CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FE				17,443,860	165,644,166.34	4.54
TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES						
JJ	CABEI	1-21S	mxAAA	1,900,000	190,481,828.60	5.23
JJ	BIDINV	1-24X	mxAAA	1,150,000	115,890,151.75	3.18
TÍTULOS EXTRANJEROS EMPRESAS MEXICANAS						
JE	AMX	0624	mxAAA	16,741	166,980,900.78	4.58
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					3,373,612,502.87	92.55
REPORTO						
LF	BONDESF	250619	mxAAA	778,196	78,023,829.39	2.14
LF	BONDESF	260115	mxAAA	778,384	77,679,671.42	2.13
TOTAL REPORTO					155,703,500.81	4.27
OTROS VALORES				1,211,021	115,910,266.65	3.18
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					3,645,226,270.33	100.00

CATEGORÍA
IDMPCALIFICACIÓN
AA/3 MOO

Para el fondo de Inversión HSBCCOR cuya clasificación es de mediano plazo, el límite de Valor en Riesgo calculado mediante simulación histórica es de 0.17%, el dato observado con la cartera al 10/04/2024 es de 0.130% y el Valor en Riesgo promedio del mes en curso es de 0.131%. A esta clasificación corresponde un Valor en Riesgo al 95% de confianza, con horizonte de siete días, utilizando 500 escenarios.

ING. ANTONIO DODERO PORTILLA