



HSBCEMP

Asset Management

HSBC-D9, 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 F						
LF	BONDES F	250619	mxAAA	1,000,000	100,374,441.00	6.87
LF	BONDES F	250130	mxAAA	994,640	99,883,027.91	6.84
LF	BONDES F	260604	mxAAA	1,000,000	99,733,808.00	6.83
LF	BONDES F	251002	mxAAA	801,540	80,555,411.23	5.51
LF	BONDES F	241003	mxAAA	500,000	50,316,416.50	3.44
LF	BONDES F	251204	mxAAA	400,000	40,114,212.80	2.75
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO MENSUAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
IM	BPAG28	250508	mxAAA	700,000	69,942,344.50	4.79
IM	BPAG28	251106	mxAAA	436,100	43,723,198.04	2.99
IM	BPAG28	241107	mxAAA	400,000	40,169,346.40	2.75
CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS						
94	BACOMER	20-2	AAA.mx	300,000	30,111,293.10	2.06
OTROS TIPO DE VALOR 94 - CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS				1,056,180	106,226,333.63	7.27
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE BANCA DE DESARROLLO						
OTROS TIPO DE VALOR CD - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE BANCA DI				1,330,700	133,661,493.79	9.15
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
91	ALSEA	19	A+(mex)	500,000	50,018,767.50	3.42
91	AC	22-2	mxAAA	300,000	30,231,018.00	2.07
OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESA				1,585,101	159,235,375.31	10.90
CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	240530	HR1	3,736,080	36,814,958.71	2.52
OTROS TIPO DE VALOR BI - CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FE				8,802,720	84,805,924.07	5.81
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					1,255,917,370.49	85.97
REPORTO						
LF	BONDES F	260115	mxAAA	1,309,772	130,710,110.43	8.95
TOTAL REPORTO					130,710,110.43	8.95
OTROS VALORES				740,500	74,211,521.86	5.08
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					1,460,839,002.78	100.00

CATEGORÍA
IDMPCALIFICACIÓN
AAA/1 MOO

Para el fondo de Inversión HSBCEMP cuya clasificación es de mediano plazo, el límite de Valor en Riesgo calculado mediante simulación histórica es de 0.09%, el dato observado con la cartera al 10/04/2024 es de 0.008% y el Valor en Riesgo promedio del mes en curso es de 0.008%. A esta clasificación corresponde un Valor en Riesgo al 95% de confianza, con horizonte de siete días, utilizando 500 escenarios.

ING. ANTONIO DODERO PORTILLA