

# HSBC-D1, S. A. de C. V., Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda (HSBCCOR)

Paseo de la Reforma No. 347, Col. Cuauhtémoc, Ciudad de México

Balances Generales

31 de diciembre de 2022 y 2021

Miles de pesos, excepto precio de las acciones

Activo	2022	2021	Pasivo y Capital Contable	2022	2021
Disponibilidades (Nota 6)	\$ -	\$ -	Cuentas por pagar:		
Inversiones en valores:			Acreedores por liquidación de operaciones	\$ -	\$ -
Títulos para negociar (Nota 4)	3,530,368	6,051,248	Provisiones para obligaciones diversas (Nota 6)	4,258	7,215
Deudores por reporto (Nota 5)	444,640	626,362	Impuesto sobre la renta por pagar	240	4,616
Cuentas por cobrar	767	2,405	<b>Total del pasivo</b>	<b>4,498</b>	<b>11,831</b>
			Capital contable (Nota 8):		
			Capital contribuido:		
			Capital social pagado	2,703,487	4,731,190
			Prima en venta (recompra) de acciones	(727,658)	176,018
				<b>1,975,829</b>	<b>4,907,208</b>
			Capital ganado:		
			Resultado de ejercicios anteriores	1,760,976	1,657,227
			Resultado neto	234,472	103,749
				<b>1,995,448</b>	<b>1,760,976</b>
			<b>Total del capital contable</b>	<b>3,971,277</b>	<b>6,668,184</b>
			Compromiso (Nota 9)	-	-
<b>Total del activo</b>	<b>\$ 3,975,775</b>	<b>\$ 6,680,015</b>	<b>Total del pasivo y capital contable</b>	<b>\$ 3,975,775</b>	<b>\$ 6,680,015</b>

Cuentas de orden	2022	2021
Capital social autorizado (Nota 8)	\$ 8,450,000,000	\$ 8,450,000,000
Colaterales recibidos (Nota 5)	\$ 444,640	\$ 626,362
Acciones emitidas (Nota 8)	500,000,000,000	500,000,000,000

Las doce notas adjuntas son parte integrante de los estados financieros.

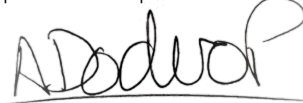
Los presentes balances generales se formularon de conformidad con los criterios de contabilidad aplicables al Fondo, emitidos por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores con fundamento en lo dispuesto por el artículo 76 de la Ley de Fondos de Inversión, de observancia general y obligatoria, aplicados de manera consistente, encontrándose reflejadas las operaciones efectuadas por el Fondo hasta las fechas arriba mencionadas, las cuales se realizaron y valoraron con apego a sanas prácticas y a las disposiciones legales y administrativas aplicables.

Los presentes balances generales fueron aprobados por el Consejo de Administración bajo la responsabilidad de los directivos que los suscriben.

La sociedad valuadora o, en su caso, la sociedad operadora de esta Fondo de Inversión determinó el precio de las acciones representativas de su capital social con base en los precios actualizados de valuación de los activos que conforman su cartera de inversión, proporcionados por el proveedor de precios que le presta sus servicios, y determinó el 31 de diciembre de 2022, el activo neto, fijándose el precio actualizado de valuación de las acciones, con valor nominal de \$16.90 correspondiente a la clase/serie A en \$ 25.470258; a la clase/serie BFA en \$ 25.871354; a la clase/serie BFE en \$ 25.805787; a la clase/serie BFP en \$ 22.648004; a la clase/serie BFS en \$ 19.323765; a la clase/serie BFV en \$ 25.513854; a la clase/serie BIX en \$ 26.349005; a la clase/serie BI1 en \$ 0.000000; a la clase/serie BMX en \$ 0.000000; a la clase/serie BM1 en \$ 0.000000 y a la clase/serie BNF en \$ 0.000000." (Al 31 de diciembre de 2021, con valor nominal de 16.9, correspondiente a la clase/serie A en \$23.899288; a la clase/serie BFA en \$ 24.430271; a la clase/serie BFE en \$ 24.368400; a la clase/serie BFP en \$ 21.525086; a la clase/serie BFS en \$ 18.378825; a la clase/serie BFV en \$ 24.204632; a la clase/serie BIX en \$ 24.806322; a la clase/serie BI1 en \$ 0.000000; a la clase/serie BMX en \$ 0.000000; a la clase/serie BM1 en \$ 0.000000 y a la clase/serie BNF en \$ 28.623398).

El saldo histórico del capital social al 31 de diciembre de 2022 y 2021, es de \$2,703,487 y \$4,731,190, respectivamente.

Los presentes balances generales serán publicados en la página de Internet [www.bmv.com.mx](http://www.bmv.com.mx) de conformidad con el artículo 79 de la Ley de Fondos de Inversión. En la página de Internet [www.cnbv.gob.mx](http://www.cnbv.gob.mx), la Comisión Nacional Bancaria y de Valores publica la información financiera que el fondo le proporciona periódicamente a dicha Comisión en cumplimiento de las disposiciones de carácter general.



Antonio Dodero Portilla  
Director General, HSBC Global Asset Management México



Arely Itzel Torres Rojas  
Contralor Normativo, HSBC Global Asset Management México

# HSBC-D1, S. A. de C. V., Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda (HSBCCOR)

Paseo de la Reforma No. 347, Col. Cuauhtémoc, Ciudad de México  
Estados de Valuación de Cartera de Inversión  
Año que terminó el 31 de diciembre de 2022 y 2021

Miles de pesos, excepto costos promedios unitarios de adquisición y valores razonables o contables unitarios

%	Emisora	Serie	Tipo de valor	Valor %	Tipo de tasa(*)	Calificación o bursatilidad (**)	Cantidad de títulos	Cantidad de títulos liquidados	Total de títulos de la emisión	Costo promedio unitario de adquisición	Costo total de adquisición	Valor razonable o contable unitario	Valor razonable o contable total	Días por vencer
31 de diciembre de 2022														
88.81%	<b>Inversión en títulos de deuda</b>													
	<b>Valores gubernamentales</b>													
	<b>Federales nacionales</b>													
	FEFA	18-3	95	10.854904	103	212	500,000	500,000	23,000,000	100.689697	\$ 50,345	100.447518	\$ 50,224	71
	FEFA	18-5	95	10.854902	103	212	150,000	150,000	6,106,500	100.731361	15,110	100.703344	15,106	288
	FEFA	21G	95	10.88248	103	212	500,000	500,000	35,000,000	100.768499	50,384	100.845758	50,423	476
	FNCO	21G	95	10.856276	103	238	209,000	209,000	15,000,000	100.967195	21,102	100.844849	21,077	508
	BONOS	231207	M	10.83009	102	212	1,100,000	1,100,000	2,723,114,000	100.101399	110,112	98.072911	107,880	339
											<u>247,052</u>		<u>244,709</u>	
	<b>Títulos bancarios</b>													
	BACOMER	19-2	94	9.67	102	267	1,000,000	1,000,000	50,000,000	102.144663	102,145	96.166380	96,166	1,621
	BACOMER	20	94	10.809999	103	267	500,000	500,000	71,230,000	100.547634	50,274	100.559099	50,280	37
	BACOMER	20-2	94	10.8	103	267	500,000	500,000	60,000,000	100.713843	50,357	100.769978	50,385	765
	BSMX	19-2	94	8.508997	102	267	990,000	990,000	71,500,000	107.805928	106,728	103.479773	102,445	1,183
	HSBC	13-2	94	11.365001	102	267	500,000	500,000	27,000,000	101.22084	50,610	97.991444	48,996	329
	BACMEXT	20	CD	10.487354	103	212	1,405,860	1,405,860	30,000,000	100.586252	141,410	100.705217	141,577	347
	BACMEXT	21-2	CD	10.68	103	212	2,500,000	2,500,000	27,150,000	100.305219	250,763	100.37642	250,941	1,225
	BACMEXT	21-3	CD	9.614994	102	212	500,000	500,000	45,360,000	96.406657	48,203	88.015116	44,008	3,045
	BANOB	19X	CD	9.4	102	212	457,400	457,400	68,596,808	102.936464	47,083	95.278963	43,351	2,340
	BANOB	20X	CD	10.63	103	212	494,985	494,985	25,000,000	100.38768	49,690	100.389818	49,691	326
	BANOB	21-2X	CD	10.63	103	212	2,500,000	2,500,000	20,000,000	100.283292	250,708	100.508682	251,167	1,169
	KEKIM	21	CD	10.815806	103	267	1,800,000	1,800,000	50,000,000	100.713877	181,285	100.554547	180,998	1,114
	NAFR	260626	CD	10.76	103	212	481,800	481,800	11,150,000	100.353206	48,350	100.415805	48,380	1,271
											<u>1,377,607</u>		<u>1,358,715</u>	
	<b>Papel privado</b>													
	ACBE	21-2V	91	9.548858	102	212	397,853	397,853	34,213,041	95.170164	37,864	89.400274	35,568	1,947
	AGUA	17-2X	91	10.465	102	215	492,900	492,900	40,000,000	99.444341	49,016	93.880145	46,274	1,626
	ALSEA	15-2	91	12.445000	102	244	270,055	270,055	10,000,000	94.037211	26,333	94.037211	25,395	802
	ALSEA	19	91	12.119993	103	297	675,214	675,214	13,500,000	99.481717	67,171	99.850675	67,421	493
	ALSEA	19-2	91	11.725	102	297	600,000	600,000	26,500,000	102.079305	61,248	96.756481	58,054	1,221
	BBVALMX	18-2	91	10.85315	102	238	1,110,000	1,110,000	22,000,000	104.824508	116,355	100.28138	111,312	599
	BIMBO	16	91	10.210000	102	213	225,000	225,000	80,000,000	96.587311	21,732	94.40289	21,241	1,339
	FERRROMX	14	91	10.575	102	212	284,291	284,291	20,000,000	98.407949	27,976	95.483462	27,145	644
	FERRROMX	21-2	91	10.978982	103	212	425,975	425,975	33,080,000	100.212505	42,688	100.161836	42,666	862
	FUNO	15	91	10.964995	102	238	1,269,918	1,269,918	75,000,000	97.300973	123,354	94.525872	120,040	933
	FUNO	18	91	11.192061	103	238	1,129,204	1,129,204	54,004,000	100.69495	113,705	100.959388	114,004	113
	FUNO	21-2X	91	11.42	103	238	375,000	375,000	52,000,000	100.549014	37,706	101.151725	37,932	1,018
	GAP	19	91	10.964458	103	212	363,720	363,720	30,000,000	100.083188	36,402	100.386612	36,513	445
	GAP	20	91	10.964457	103	212	832,793	832,793	30,000,000	99.701053	83,030	100.467207	83,668	766
	GAP	21	91	10.964458	103	212	382,000	382,000	25,000,000	100.897935	38,543	101.345507	38,714	851
	GMXT	17	91	10.219528	102	212	60,000	60,000	135,250,000	99.886021	5,981	93.978528	5,639	1,719
	GMXT	19-2	91	11.474023	103	212	300,000	300,000	17,250,000	99.867508	29,900	100.192126	30,058	259
	GPH	19-2	91	10.405002	102	238	785,432	785,432	40,000,000	94.819037	74,474	89.366229	70,191	2,468
	HERDEZ	20	91	10.867297	102	214	500,000	500,000	25,000,000	93.550493	46,775	86.972974	43,486	2,780
	HERDEZ	20-2	91	11.634066	103	214	500,000	500,000	10,000,000	100.612363	50,306	100.672029	50,336	960
	KOF	17	91	9.867221	102	212	500,000	500,000	85,000,000	98.738735	49,369	93.068086	46,534	1,628
	LALA	19-2	91	11.191353	103	241	587,167	587,167	37,500,000	99.299035	58,305	100.706686	59,132	877
	LIVEPOL	19	91	10.211451	102	212	400,000	400,000	50,000,000	93.877238	37,551	90.181128	36,064	2,495
	OMA	21V	91	10.899885	103	267	33,300	33,300	10,000,000	100.3186	3,341	102.064477	3,399	1,194
	SORIANA	20	91	11.145000	103	239	200,000	200,000	27,000,000	100.89847	20,180	100.92229	20,185	283
	TOYOTA	17-2	91	11.305001	102	212	191,593	191,593	18,750,000	103.08077	19,750	100.97302	19,346	435
	AMX	0624	JE	10.540000	102	101	16,741	16,741	750,000	97.170946	162,674	9454.56303	158,279	707
	BIDINV	1-20	JI	10.790001	103	212	616,000	616,000	20,000,000	100.563572	61,947	100.517038	61,918	291
	BIDINV	1-21G	JI	10.790000	103	212	1,150,000	1,150,000	25,000,000	100.106859	115,123	100.124568	115,143	443
	CABEI	1-20	JI	10.669232	103	212	1,500,000	1,500,000	43,113,855	100.674874	43,113,855	100.087987	150,132	81
	CABEI	1-21S	JI	10.510000	103	212	1,900,000	1,900,000	50,000,000	100.645537	191,227	100.60842	191,156	536
											<u>1,961,249</u>		<u>1,926,944</u>	
											<u>3,585,909</u>		<u>3,530,368</u>	
11.19%	<b>Deudores por reporte</b>													
	<b>Inversión respaldada por</b>													
	<b>títulos de deuda</b>													
	BPAG91	250102	IQ	10.510000	103	212	11,666	11,666	249,000,000	101.913434	1,189	102.002693	1,190	-
	BPAG91	260903	IQ	10.510000	103	212	2,208,804	2,208,804	270,040,000	100.081892	221,061	100.169547	221,255	-
	BONDES	261231	LF	10.550000	103	212	2,223,513	2,223,513	728,802,000	99.841998	222,000	99.929775	222,195	-
											<u>444,250</u>		<u>444,640</u>	
											<u>\$ 4,030,159</u>		<u>\$ 3,975,008</u>	



# HSBC-D1, S. A. de C. V., Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda (HSBCCOR)

Paseo de la Reforma No. 347, Col. Cuauhtémoc, Ciudad de México  
Estados de Valuación de Cartera de Inversión  
Año que terminó el 31 de diciembre de 2022 y 2021

---

\*Tipo de tasa:

101 Tasa de rendimiento (aplica a cupón cero)  
102 Tasa fija (aplica a bonos con pagos de interés periódicos)  
103 Tasa variable (aplica a bonos con pagos de interés periódicos)  
104 Tasa real  
105 No aplica

\*\*Calificación o bursatilidad:

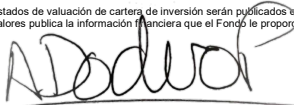
212: mxAAA: Capacidad de pago sustancialmente fuerte; SP; Local; Largo Plazo  
213: mxAA+: Muy fuerte capacidad de pago; SP; Local; Largo Plazo  
215: mxAA-: Muy fuerte capacidad de pago; SP; Local; Largo Plazo  
231: mx-1+: La más fuerte seguridad de pago oportuno; SP; Local; Corto Plazo  
238: AAA (mex): La más alta calidad crediticia; FI; Local; Largo Plazo  
239: AA+ (mex): Muy alta calidad crediticia; FI; Local; Largo Plazo  
240: AA (mex): Muy alta calidad crediticia; FI; Local; Largo Plazo  
241: AA- (mex): Muy alta calidad crediticia; FI; Local; Largo Plazo  
242: A+ (mex): Alta calidad crediticia; FI; Local; Largo Plazo  
267: Aaa.mx: Capacidad crediticia más fuerte; MO; Local; Largo Plazo  
268: Aa1.mx: Capacidad crediticia muy fuerte; MO; Local; Largo Plazo  
269: Aa2.mx: Capacidad crediticia muy fuerte; MO; Local; Largo Plazo

Las doce notas adjuntas son parte integrante de los estados financieros.


Los presentes estados de valuación de cartera de inversión se formularon de conformidad con los criterios de contabilidad aplicables al Fondo, emitidos por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores con fundamento en el artículo 76 de la Ley de Fondos de Inversión, de observancia general y obligatoria, aplicados de manera consistente, encontrándose reflejadas las operaciones con activos objetos de inversión efectuadas por el Fondo hasta las fechas arriba mencionadas, las cuales se realizaron y valoraron con apego a sanas prácticas y a las disposiciones legales y administrativas aplicables.

Los presentes estados de valuación de cartera de inversión fueron aprobados por el Consejo de Administración bajo la responsabilidad de los directivos que los suscriben.

Los presentes estados de valuación de cartera de inversión serán publicados en la página de Internet [www.bmv.com.mx](http://www.bmv.com.mx) de conformidad con el artículo 79 de la Ley de Fondos de Inversión. En la página de Internet [www.cnbv.gob.mx](http://www.cnbv.gob.mx) la Comisión Nacional Bancaria y de Valores publica la información financiera que el Fondo le proporciona periódicamente a dicha Comisión en cumplimiento de las disposiciones de carácter general.



Antonio Dodero Portilla  
Director General, HSBC Global Asset Management México



Arely Itzel Torres Rojas  
Contralor Normativo, HSBC Global Asset Management México

# HSBC-D1, S. A. de C. V., Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda (HSBCCOR)

Paseo de la Reforma No. 347, Col. Cuauhtémoc, Ciudad de México

Estados de Resultados

Año que terminó el 31 de diciembre de 2022 y 2021

*Miles de pesos*

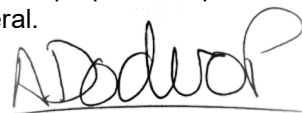
	2022	2021
Ingresos		
Resultado por valuación a valor razonable	\$ (55,540)	\$ (182,104)
Resultado por compra-venta	(25,873)	(40,635)
Ingresos por intereses (Nota 5)	378,331	530,793
Otros ingresos	113	-
Ingresos totales	<u>297,031</u>	<u>308,054</u>
Egresos		
Servicios administrativos, de operación y distribución pagados a Operadora (Notas 1 y 6)	49,757	100,181
Servicios administrativos y de distribución pagados a otras entidades	1,208	2,299
Gastos por intereses	2	-
Gastos de administración	29	65
Impuestos (Nota 9)	11,383	101,578
Otros gastos de administración	180	182
Egresos totales	<u>62,559</u>	<u>204,305</u>
Resultado neto	<u>\$ 234,472</u>	<u>\$ 103,749</u>

Las doce notas adjuntas son parte integrante de los estados financieros.

Los presentes estados de resultados se formularon de conformidad con los criterios de contabilidad aplicables al Fondo, emitidos por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores con fundamento en lo dispuesto por el artículo 76 de la Ley de Fondos de Inversión, de observancia general y obligatoria, aplicados de manera consistente, encontrándose reflejados todos los ingresos y egresos derivados de las operaciones efectuadas por el fondo hasta las fechas arriba mencionadas, las cuales se realizaron y valoraron con apego a sanas prácticas y a las disposiciones legales y administrativas aplicables.

Los presentes estados de resultados fueron aprobados por el Consejo de Administración bajo la responsabilidad de los directivos que los suscriben.

Los presentes estados de resultados serán publicados en la página de Internet [www.bmv.com.mx](http://www.bmv.com.mx) de conformidad con el artículo 79 de la Ley de Fondos de Inversión. En la página de Internet [www.cnbv.gob.mx](http://www.cnbv.gob.mx), la Comisión Nacional Bancaria y de Valores publica la información financiera que el Fondo le proporciona periódicamente a dicha Comisión en cumplimiento de las disposiciones de carácter general.



Antonio Dodero Portilla  
Director General, HSBC Global Asset  
Management México



Arely Itzel Torres Rojas  
Contralor Normativo, HSBC Global Asset  
Management México

# HSBC-D1, S. A. de C. V., Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda (HSBCCOR)

Paseo de la Reforma No. 347, Col. Cuauhtémoc, Ciudad de México

## Estados de Variaciones en el Capital Contable

Año que terminó el 31 de diciembre de 2022 y 2021

Miles de pesos

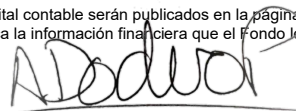
	Capital contribuido				Capital ganado			
	Capital social				Prima en venta (recompra) de acciones	Resultado de ejercicios anteriores	Resultado neto	Total del capital contable
	Autorizado		No pagado	Total pagado				
Fijo	Variable							
Saldos al 31 de diciembre de 2020	\$ 1,000	\$ 8,449,999,000	\$ (8,440,631,459)	\$ 9,368,541	\$ 2,182,373	\$ 1,062,838	\$ 594,388	\$ 13,208,140
Movimientos inherentes a acuerdos de los accionistas:								
Traspaso del resultado del ejercicio anterior	-	-	-	-	-	594,388	(594,388)	-
Recompra de acciones - Neto	-	-	(4,637,351)	(4,637,351)	(2,006,355)	-	-	(6,643,705)
Movimiento inherente a la operación:								
Resultado neto	-	-	-	-	-	-	103,749	103,749
Saldos al 31 de diciembre de 2021	1,000	8,449,999,000	(8,445,268,810)	4,731,190	176,018	1,657,227	103,749	6,668,184
Movimientos inherentes a acuerdos de los accionistas:								
Traspaso del resultado del ejercicio anterior	-	-	-	-	-	103,749	(103,749)	-
Recompra de acciones - Neto	-	-	(2,027,701)	(2,027,701)	(903,676)	-	-	(2,931,379)
Movimiento inherente a la operación:								
Resultado neto	-	-	-	-	-	-	234,472	234,472
Saldos al 31 de diciembre de 2022	\$ 1,000	\$ 8,449,999,000	\$ (8,447,296,511)	\$ 2,703,487	\$ (727,658)	\$ 1,760,976	\$ 234,472	\$ 3,971,277

Las doce notas adjuntas son parte integrante de los estados financieros.

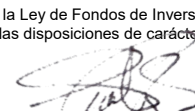
Los presentes estados de variaciones en el capital contable se formularon de conformidad con los criterios de contabilidad aplicables al Fondo, emitidos por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores con fundamento en lo dispuesto por el artículo 76 de la Ley de Fondos de Inversión, de observancia general y obligatoria, aplicados de manera consistente, encontrándose reflejadas las operaciones efectuadas por el Fondo hasta las fechas arriba mencionadas, las cuales se realizaron y valoraron con apego a sanas prácticas y a las disposiciones legales y administrativas aplicables.

Los presentes estados de variaciones en el capital contable fueron aprobados por el Consejo de Administración bajo la responsabilidad de los directivos que los suscriben.

Los presentes estados de variaciones en el capital contable serán publicados en la página de Internet [www.bmv.com.mx](http://www.bmv.com.mx) de conformidad con el artículo 79 de la Ley de Fondos de Inversión. En la página de Internet [www.cnbv.gob.mx](http://www.cnbv.gob.mx), la Comisión Nacional Bancaria y de Valores publica la información financiera que el Fondo le proporciona periódicamente a dicha Comisión en cumplimiento de las disposiciones de carácter general.



Antonio Dodero Portilla  
Director General, HSBC Global Asset Management México



Arely Itzel Torres Rojas  
Contralor Normativo, HSBC Global Asset Management México