

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO
SIEFORE SURA BASICA 80-84, S.A. DE C.V., SOCIEDAD DE INVERSIÓN ESPECIALIZADA DE FONDOS PARA EL RETIRO
SOCIEDAD DE INVERSIÓN BÁSICA
ESTADO DE SITUACIÓN FINANCIERA AL 30 DE JUNIO DE 2023 Y 2022

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2023	2022	PASIVO	2023	2022
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	10	514,908	Acreedores	459,704	785,581
Bancos monedas extranjeras	114,217	56,055	Provisiones para gastos	13,062	8,873
Divisas por recibir	569,505	72,279	Divisas por entregar	564,075	73,074
	683,732	643,242	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	2,081,409	3,657,806
RESERVADOS			TOTAL PASIVO	3,118,249	4,525,335
Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en divisas	-	15,107			
	-	15,107			
INVERSIONES			CAPITAL CONTABLE	2023	2022
Inversión en valores de renta variable	26,738,194	25,953,969	CAPITAL		
Plus (Minus) valia en valores de renta variable	(607,347)	(1,383,484)	CAPITAL CONTRIBUIDO	111,965,183	104,359,870
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	32,649,697	27,254,928	Capital social pagado	113,195,583	106,656,288
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	2,812,393	2,452,918	Prima en venta de acciones	(1,230,399)	(2,296,419)
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	45,454,999	42,763,396	CAPITAL GANADO	27,375,175	19,340,718
Plus (Minus) valia en instrum. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	(2,496,542)	(3,638,618)	Resultados de ejercicios anteriores	22,370,658	20,771,764
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	2,361,244	2,241,065	Resultados del ejercicio	5,004,517	(1,431,046)
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	(555,019)	(294,013)	OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	1,988,972	3,459,490	PLUS (MINUS) VALÍAS	(1,396,101)	(3,081,918)
Plus (Minus) valia instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	36,641	(33,348)			
Inversión en FIBRAS	4,013,777	3,313,006	TOTAL CAPITAL CONTABLE	137,944,258	120,618,669
Plus (Minus) valia en Inversion en FIBRAS	(204,561)	(614,708)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	-	44,229			
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	-	4,020			
Inversión en valores extranjeros de deuda	730,910	465,610			
Plus (Minus) valia en Inversión en valores extranjeros de deuda	(6,099)	(25,303)			
Inversión en títulos Fiduciarios	12,283,631	10,918,796			
Plus (minus) valia en Títulos Fiduciarios	792,165	1,249,409			
Valores Prestados	691,885	449,848			
Plus (Minus) valia de valores prestados	(42,497)	(81,051)			
Inversión en Fondos Mutuos	6,161,397	5,908,844			
Plus (Minus) valia de Fondos Mutuos	(1,125,236)	(713,722)			
	131,678,605	119,695,282			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	4,773	44,931			
Dividendos o derechos por cobrar	8,332	90			
Intereses devengados sobre valores	854,246	802,400			
Reportos	6,333,073	2,493,858			
Premios por cobrar por préstamo de valores	36	5			
Intereses devengados sobre valores prestados	5,483	2,078			
Reembolsos y otros intereses	152	2,229			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	1,494,076	1,444,782			
	8,700,171	4,790,372			
TOTAL ACTIVO	141,062,507	125,144,004	TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	141,062,507	125,144,004

CUENTAS DE ORDEN	2023	2022	CUENTAS DE ORDEN	2023	2022
Valores entregados en custodia	131,029,217	118,912,037	Capital social autorizado	35,000,100	35,000,100
Valores prestados	649,388	368,797	Acciones emitidas	35,000,100,000	35,000,100,000
Garantías recibidas por valores prestados	678,634	387,691	Acciones en circulación, posición propia	60,860,568	59,393,140
Colaterales recibidos por reportos	6,336,672	2,492,024	Acciones de Siefores, posición de terceros	1	1
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	193,227	569,776	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	11,258,697,716	10,606,235,706
Bancos divisas en moneda extranjera	6,565	2,872			
Dólares americanos	5,367	2,464			
Euros	1,148	-			
Otras Divisas	49	408			
Divisas por recibir	33,274	3,590			
Dólares americanos	33,274	3,590			
Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en moneda extranjera	-	750			
Dólares americanos	-	750			
Divisas por entregar	32,957	3,629			
Dólares americanos	32,957	3,629			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	5,168,595	6,091,248			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	69,561,356	87,984,551			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	22,815,862	25,477,788			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	11,363,525	7,214,655			
Contratos Adelantados sobre Euros	3,408,956	2,612,235			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	1,655,776	1,686,086			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	107,040	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	15,778,655	25,726,922			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	6,733,812	6,547,930			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	1,268,099	1,622,069			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	161,504	161,504			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	4,190,350	12,678,350			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	2,077,777	4,255,343			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	-	1,668			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	43,735,818	64,203,923			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	253,610	-			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	10,114,121	9,066,974			
Contratos Adelantados sobre Euros	1,310,837	2,535,726			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	1,499,256	1,304,113			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	2,979,200	11,467,200			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	2,903,205	5,687,425			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	1,416,521	1,416,521			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	203,915	203,915			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	15,797,286	25,450,063			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	7,096,364	6,910,482			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	161,504	161,504			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	-\$	1,396,101	-\$	3,081,918
Un valor de los activos netos de:	\$	137,944,258	\$	120,618,669
El precio de la acción de:	\$	12.186364	\$	11.309101

GABRIEL VILLAGÓMEZ GÓMEZ
Contador General de SIEFORE

EMILIO BERTRÁN RODRÍGUEZ
Director General

Los presentes estados financieros han sido formulados de acuerdo a las reglas de agrupación de cuentas establecidas por la Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro y bajo la estricta responsabilidad de los funcionarios que suscriben.

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO
SIEFORE SURA BASICA 80-84, S.A. DE C.V., SOCIEDAD DE INVERSIÓN ESPECIALIZADA DE FONDOS PARA EL RETIRO
SOCIEDAD DE INVERSIÓN BÁSICA
ESTADOS DE RESULTADOS INTEGRAL POR LOS PERIODOS DEL 1 DE ENERO AL 30 DE JUNIO DE 2023 Y 2022

(Cifras en miles de pesos)

	2023	2022
Ingresos por la venta de Valores	9,750,686	13,846,702
Intereses, dividendos, premios y derechos	3,789,781	3,605,196
Resultado cambiario / Otros productos	(179,623)	(27,125)
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	2,474,758	(5,255,523)
INGRESOS NETOS	15,835,602	12,169,250
Costo de ventas de valores	10,423,732	13,232,907
Gastos generales	13,243	12,462
Comisiones sobre saldos	381,184	340,331
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	12,926	14,596
EGRESOS NETOS	10,831,085	13,600,296
UTILIDAD DE OPERACIÓN	5,004,517	(1,431,046)
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	522,196	(9,217,178)
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	5,526,713	(10,648,225)

GABRIEL VILLAGÓMEZ GÓMEZ
 Contador General de SIEFORE

EMILIO BERTRÁN RODRÍGUEZ
 Director General

Los presentes estados financieros han sido formulados de acuerdo a las reglas de agrupación de cuentas establecidas por la Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro y bajo la estricta responsabilidad de los funcionarios que suscriben.
 En la Sesión del Consejo de Administración con fecha 3 de Mayo de 2023 fueron aprobados los Estados Financieros del 31 de Marzo de 2023, asimismo los presentes Estados Financieros al 30 de Junio de 2023 serán aprobados en la Sesión del Consejo de Administración con fecha 9 de Agosto de 2023