

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 SEPTIEMBRE DE 2023 Y 2022

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2023	2022	PASIVO	2023	2022
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	527	25	Acreedores	2,084,657	897,377
Bancos monedas extranjeras	1,413,951	74,344	Provisiones para gastos	13,671	13,025
Divisas por recibir	-	886,079	Divisas por entregar	-	915,512
	1,414,478	960,449	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	2,610,427	5,384,353
RESERVADOS			TOTAL PASIVO	4,708,755	7,210,267
Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en divisas	33,796	-			
	33,796	-			
INVERSIONES			CAPITAL CONTABLE	2023	2022
Inversión en valores de renta variable	28,583,193	28,092,557	CAPITAL		
Plus (Minus) valia en valores de renta variable	(1,350,807)	(3,802,551)	CAPITAL CONTRIBUIDO		
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	32,448,150	27,939,952	Capital social pagado	115,502,417	108,845,246
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	1,287,754	1,659,407	Prima en venta de acciones	(765,479)	(2,037,863)
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	46,293,243	41,139,571	CAPITAL GANADO	27,090,470	18,843,867
Plus (Minus) valia en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(4,420,842)	(4,399,270)	Resultados de ejercicios anteriores	22,370,658	20,771,764
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	2,361,260	2,241,065	Resultados del ejercicio	4,719,812	(1,927,897)
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	(574,746)	(410,117)	OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	3,407,911	4,960,618	PLUS (MINUS) VALÍAS	(6,073,483)	(7,743,430)
Plus (Minus) valia instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	(104,962)	(52,046)	TOTAL CAPITAL CONTABLE	135,753,924	117,907,820
Inversión en FIBRAS	4,037,372	3,348,446			
Plus (Minus) valia en Inversion en FIBRAS	(143,125)	(581,600)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	9,469	12,453			
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	-	10,712			
Inversión en valores extranjeros de deuda	730,910	518,910			
Plus (Minus) valia en Inversión en valores extranjeros de deuda	(41,964)	(36,912)			
Inversión en títulos Fiduciarios	14,055,345	11,217,129			
Plus (minus) valia en Títulos Fiduciarios	404,972	1,078,265			
Valores Prestados	-	242,807			
Plus (Minus) valia de valores prestados	-	(23,249)			
Inversión en Fondos Mutuos	6,093,100	5,908,844			
Plus (Minus) valia de Fondos Mutuos	(1,129,764)	(1,175,356)			
	131,946,471	117,889,635			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	394,582	523			
Dividendos o derechos por cobrar	11,886	14,056			
Intereses devengados sobre valores	1,424,739	1,201,607			
Reportos	4,120,167	3,190,461			
Premios por cobrar por préstamo de valores	-	19			
Intereses devengados sobre valores prestados	-	998			
Reembolsos y otros intereses	166	2,863			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	1,116,394	1,857,475			
	7,067,935	6,268,003			
TOTAL ACTIVO	140,462,680	125,118,087	TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	140,462,680	125,118,087

CUENTAS DE ORDEN	2023	2022	CUENTAS DE ORDEN	2023	2022
Valores entregados en custodia	131,937,002	117,297,512	Capital social autorizado	35,000,100	35,000,100
Valores prestados	-	219,558	Acciones emitidas	35,000,100,000	35,000,100,000
Garantías recibidas por valores prestados	-	224,274	Acciones en circulación, posición propia	60,212,817	58,606,329
Colaterales recibidos por reportos	4,125,642	3,191,147	Acciones de Siefores, posición de terceros	1	1
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	31,482	525,281	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	11,490,028,858	10,825,918,261
Bancos divisas en moneda extranjera	76,936	3,800			
Dólares americanos	3,137	3,420			
Euros	73,754	-			
Otras Divisas	45	380			
Divisas por recibir	-	44,100			
Dólares americanos	-	44,100			
Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en moneda extranjera	1,939	-			
Dólares americanos	1,939	-			
Divisas por entregar	-	45,565			
Dólares americanos	-	45,565			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	5,099,813	5,788,941			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	75,673,867	91,898,084			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	26,044,836	27,875,308			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	14,042,363	10,898,706			
Contratos Adelantados sobre Euros	450,805	610,115			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	3,046,317	2,632,610			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	226,675	199,055			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	18,550,255	29,652,922			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	7,684,150	6,218,434			
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	2,340,750	7,770,350			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	1,858,113	4,255,343			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	-	1,668			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	51,646,451	70,458,968			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	2,105,205	2,623,638			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	14,907,895	14,239,179			
Contratos Adelantados sobre Euros	-	1,078,634			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	2,422,682	2,531,903			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	1,129,600	6,559,200			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	2,683,541	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	18,568,886	29,376,063			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	8,046,702	6,580,986			
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:	-\$	6,073,483	-\$	7,743,430
Un valor de los activos netos de:	\$	135,753,924	\$	117,907,820
El precio de la acción de:	\$	11.753341	\$	10.832611

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 SEPTIEMBRE DE 2023 Y 2022**

(Cifras en miles de pesos)

	2023	2022
Ingresos por la venta de Valores	14,711,367	22,026,348
Intereses, dividendos, premios y derechos	5,489,708	5,164,456
Resultado cambiario / Otros productos	(244,386)	4,933
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	733,573	(6,881,143)
INGRESOS NETOS	20,690,261	20,314,595
Costo de ventas de valores	15,355,978	21,678,216
Gastos generales	18,483	21,072
Comisiones sobre saldos	576,966	521,620
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	19,022	21,584
EGRESOS NETOS	15,970,450	22,242,492
UTILIDAD DE OPERACIÓN	4,719,812	(1,927,897)
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(4,155,186)	(13,878,690)
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	564,625	(15,806,587)

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 9 de Agosto de 2023 fueron aprobados los Estados Financieros del 30 de Junio de 2023, asimismo los presentes Estados Financieros al 29 de Septiembre de 2023 serán aprobados en la Sesión del Consejo de Administración con fecha 24 de Noviembre de 2023