

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

**SIEFORE SURA BASICA 85-89, 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 2022 Y 2021

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO		2022	2021	PASIVO		2022	2021
DISPONIBLE				OBLIGACIONES			
Bancos moneda nacional		8,352	11	Acreedores		735,415	746,560
Bancos monedas extranjeras		41,134	48,455	Provisiones para gastos		6,582	8,225
Divisas por recibir		91,398	88,607	Divisas por entregar		87,277	-
		140,883	137,072	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)		5,289,682	4,380,620
RESERVADOS				TOTAL PASIVO		6,118,956	5,135,405
Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en divisas		20,704	-				
		20,704	-				
INVERSIONES				CAPITAL CONTABLE		2022	2021
Inversión en valores de renta variable		21,266,780	15,378,436	CAPITAL			
Plus (Minus) valia en valores de renta variable		(1,181,438)	1,786,768	CAPITAL CONTRIBUIDO		20,705,792	8,303,191
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís		19,194,755	12,833,999	Capital soc al pagado		32,580,059	28,331,944
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís		1,215,527	1,491,054	Prima en venta de acciones		(11,874,267)	(20,028,752)
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos		32,215,632	29,243,828	CAPITAL GANADO		72,960,034	71,039,529
Plus (Minus) valia en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos		(2,823,132)	(14,606)	Resultados de ejercicios anteriores		74,614,971	65,663,719
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso		1,485,950	1,557,935	Resultados del ejercicio		(1,654,938)	5,375,809
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso		(250,550)	164,122	OTROS RESULTADOS INTEGRALES			
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas		2,811,748	1,389,575	PLUS (MINUS) VALÍAS		(3,164,911)	3,639,539
Plus (Minus) valia instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas		(53,628)	124,389				
Inversión en FIBRAS		2,184,239	1,910,959	TOTAL CAPITAL CONTABLE		90,500,914	82,982,259
Plus (Minus) valia en Inversion en FIBRAS		(346,356)	(297,993)				
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados		29,849	995				
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)		2,566	18				
Inversión en valores extranjeros de deuda		522,405	64,945				
Plus (Minus) valia en Inversión en valores extranjeros de deuda		(24,304)	3,365				
Inversión en títulos Fiduciarios		7,740,675	5,471,593				
Plus (minus) valia en Títulos Fiduciarios		907,746	(41,830)				
Valores Prestados		267,167	153,928				
Plus (Minus) valia de valores prestados		(51,117)	2,523				
Inversión en Fondos Mutuos		4,400,564	4,370,720				
Plus (Minus) valia de Fondos Mutuos		(557,661)	421,746				
		88,957,417	76,016,471				
DEUDORES DIVERSOS							
Liquidadora		90,027	128,371				
Div dencos o derechos por cobrar		50	993				
Intereses devengados sobre valores		593,834	475,117				
Reportos		3,589,714	7,134,648				
Premios por cobrar por préstamo de valores		3	4				
Intereses devengados sobre valores prestados		1,222	656				
Reembolsos y otros intereses		106	-				
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)		3,225,909	4,224,332				
		7,500,865	11,964,121				
TOTAL ACTIVO		96,619,870	88,117,664	TOTAL PASIVO MAS CAPITAL		96,619,870	88,117,664

CUENTAS DE ORDEN	2022	2021	CUENTAS DE ORDEN	2022	2021
Valores entregados en custodia	88,708,953	75,859,007	Capital social autorizado	126,259,200	126,259,200
Valores prestados	216,050	156,451	Acciones emitidas	25,000,019,801	25,000,019,801
Garantías recibidas por valores prestados	224,990	160,591	Acciones en circulación, posición propia	35,916,569	34,793,347
Colaterales recibidos por reportos	3,591,932	7,137,941	Acciones de Siefores, posición de terceros	2	2
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	221,212	751,013	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	6,415,115,310	5,575,088,161
Bancos divisas en moneda extranjera	2,110	2,434			
Dólares americanos	1,798	2,434			
Otras Divisas	312	-			
Divisas por recibir	4,540	4,451			
Dólares americanos	4,540	4,451			
Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en moneda extranjera	1,028	-			
Dólares americanos	1,028	-			
Divisas por entregar	4,335	-			
Dólares americanos	4,335	-			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	4,103,146	4,953,855			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	121,167,502	159,486,787			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	20,922,587	17,758,546			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	6,243,077	5,459,897			
Contratos Adelantados sobre Euros	2,172,179	6,117,703			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	1,639,039	1,894,102			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	-	238,658			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	37,693,507	32,596,101			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	12,178,281	33,591,665			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	2,663,307	3,544,639			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	119,905	119,905			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	24,712,179	26,760,871			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	12,822,376	31,317,003			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	1,065	87,696			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	100,597,538	140,811,133			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	-	933,074			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	7,101,313	5,280,809			
Contratos Adelantados sobre Euros	2,090,210	4,969,701			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	1,312,324	1,369,903			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	-	435,300			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	23,732,403	24,898,603			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	13,466,076	32,005,142			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	2,179,600	3,061,883			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	123,685	266,202			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	37,110,450	32,695,653			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	13,361,573	34,774,958			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	119,905	119,905			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	-\$	3,164,911	\$	3,639,539
Un valor de los activos netos de:	\$	90,500,914	\$	82,982,259
El precio de la acción de:	\$	14.028905	\$	14.792159

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 85-89, 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 2022 Y 2021

(Cifras en miles de pesos)

	2022	2021
Ingresos por la venta de Valores	11,718,974	20,280,341
Intereses, dividendos, premios y derechos	2,590,778	1,928,780
Resultado cambiario / Otros productos	(30,271)	(24,666)
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	(4,529,102)	1,763,200
INGRESOS NETOS	9,750,380	23,947,655
Costo de ventas de valores	11,130,252	18,224,597
Gastos generales	10,650	14,594
Comisiones sobre saldos	253,637	321,147
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	10,778	11,507
EGRESOS NETOS	11,405,317	18,571,845
UTILIDAD DE OPERACIÓN	(1,654,938)	5,375,809
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(6,902,379)	(2,471,451)
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	(8,557,317)	2,904,358

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.