

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

**SIEFORE SURA BASICA 55-59, 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 2022 Y 2021

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2022	2021	PASIVO	2022	2021
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	10	10	Acreedores	33,416	10
Bancos monedas extranjeras	20,146	85,518	Provisiones para gastos	910	642
Divisas por recibir	26,120	-	Divisas por entregar	26,225	1,279
	46,276	85,528	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	898,093	861,137
INVERSIONES			TOTAL PASIVO	958,644	863,067
Inversión en valores de renta variable	1,197,888	497,381			
Plus (Minus) valia en valores de renta variable	(169,310)	52,355			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	6,721,784	7,355,196			
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	1,064,498	1,781,139			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	5,228,011	6,656,023			
Plus (Minus) valia en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(516,448)	(50,336)			
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	318,605	340,537			
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	(34,940)	87,111			
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	668,071	492,105			
Plus (Minus) valia instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	3,450	23,854			
Inversión en FIBRAS	597,451	601,256			
Plus (Minus) valia en Inversion en FIBRAS	(139,139)	(103,748)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	1,366	1,217			
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	368	3			
Inversión en valores extranjeros de deuda	129,591	141,591			
Plus (Minus) valia en Inversión en valores extranjeros de deuda	19,049	26,382			
Inversión en Fondos Mutuos	138,739	145,350			
Plus (Minus) valia de Fondos Mutuos	(24,309)	18,452			
	15,204,725	18,065,869			
DEUDORES DIVERSOS			CAPITAL CONTABLE	2022	2021
Liquidadora	50	48	CAPITAL		
Dividendos o derechos por cobrar	438	385	CAPITAL CONTRIBUIDO	(155,548)	2,288,074
Intereses devengados sobre valores	231,757	228,183	Capital social pagado	4,883,586	5,639,340
Reportos	267,358	228,337	Prima en venta de acciones	(5,039,134)	(3,351,266)
Reembolsos y otros intereses	2,339	1,022	CAPITAL GANADO	15,324,031	14,219,107
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	577,034	596,086	Resultados de ejercicios anteriores	14,472,293	13,096,011
	1,078,976	1,054,061	Resultados del ejercicio	851,738	1,123,096
	16,329,977	19,205,459	OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
TOTAL ACTIVO			PLUS (MINUS) VALÍAS	202,850	1,835,210
			TOTAL CAPITAL CONTABLE	15,371,333	18,342,392
			TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	16,329,977	19,205,459

CUENTAS DE ORDEN	2022	2021	CUENTAS DE ORDEN	2022	2021
Valores entregados en custodia	14,900,791	17,809,050	Capital social autorizado	11,354,689	11,354,689
Colaterales recibidos por reportos	267,177	228,438	Acciones emitidas	3,200,028,183	3,200,028,183
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	172,569	174,614	Acciones en circulación, posición propia	7,684,121	10,843,322
Bancos divisas en moneda extranjera	1,006	3,769	Acciones de Siefores, posición de terceros	1,127	1,127
Dólares americanos	994	1,291	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	1,368,628,337	1,578,459,175
Euros	-	2,478			
Otras Divisas	12	-			
Divisas por recibir	1,300	-			
Dólares americanos	1,300	-			
Divisas por entregar	1,305	62			
Dólares americanos	1,305	62			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	18,216,403	20,906,657			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	300,662	593,403			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	548,394	736,501			
Contratos Adelantados sobre Euros	14,558	-			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	101,534	31,943			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	-	202,465			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	10,153,864	7,193,237			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	680,807	2,226,173			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	1,013,377	1,201,498			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	36,706	36,706			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	5,244,346	6,492,746			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	117,434	2,187,265			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	4,722	4,722			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	18,112,797	20,279,813			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	52,527	328,656			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	614,753	581,019			
Contratos Adelantados sobre Euros	24,347	-			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	141,882	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	4,309,677	5,558,077			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	458,726	2,556,272			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	906,062	906,062			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	17,229	81,495			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	10,741,727	7,876,999			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	809,162	2,354,528			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	36,706	36,706			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$	202,850	\$	1,835,210
Un valor de los activos netos de:	\$	15,371,333	\$	18,342,392
El precio de la acción de:	\$	11.168482	\$	11.541150

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 55-59, 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 2022 Y 2021**

(Cifras en miles de pesos)

	2022	2021
Ingresos por la venta de Valores	6,372,421	4,536,722
Intereses, dividendos, premios y derechos	720,983	760,281
Resultado cambiario / Otros productos	(11,819)	3,331
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	(173,822)	19,315
INGRESOS NETOS	6,907,763	5,319,649
Costo de ventas de valores	5,982,496	4,071,881
Gastos generales	1,834	2,473
Comisiones sobre saldos	71,165	121,491
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	531	707
EGRESOS NETOS	6,056,025	4,196,553
UTILIDAD DE OPERACIÓN	851,738	1,123,096
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(1,668,955)	(1,125,589)
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	(817,217)	(2,493)

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 11 de julio de 2022 fueron aprobados los Estados Financieros del 30 de Junio de 2022,
asimismo los presentes Estados Financieros al 30 de Septiembre de 2022 serán aprobados en la Sesión del Consejo de Administración con fecha 11 de octubre de 2022