

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO
SIEFORE SURA BASICA 70-74, S.A. DE C.V., SOCIEDAD DE INVERSIÓN ESPECIALIZADA DE FONDOS PARA EL RETIRO
SOCIEDAD DE INVERSIÓN BÁSICA
ESTADO DE SITUACIÓN FINANCIERA AL 31 DE MARZO DE 2023 Y 2022

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2023	2022	PASIVO	2023	2022
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	28	10	Acreedores	1,703,575	678,710
Bancos monedas extranjeras	1,280,198	690,131	Provisiones para gastos	13,424	9,332
Divisas por recibir	-	421,638	Divisas por entregar	269,164	728,390
	1,280,226	1,111,780	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	1,881,159	2,848,337
INVERSIONES			TOTAL PASIVO	3,867,322	4,264,770
Inversión en valores de renta variable	26,729,596	24,180,522			
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	(262,110)	1,552,831			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	43,115,093	39,299,224			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	5,695,130	5,257,793			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	49,283,845	48,898,203			
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(3,055,422)	(2,709,505)			
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	3,075,034	2,944,422			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	(410,309)	214,951			
Inversión en Depósito Banxico	176,176	155,427			
Plus (Minus) valía en Depósito Banxico	2,951	2,973			
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	2,527,521	2,010,068			
Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	57,688	33,729			
Inversión en FIBRAS	4,551,491	4,196,641			
Plus (Minus) valía en Inversión en FIBRAS	(341,316)	(693,898)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	80,911	59,238			
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	-	7,716			
Inversión en valores extranjeros de deuda	1,453,413	658,408			
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	(20,260)	(13,737)			
Inversión en títulos Fiduciarios	13,313,959	11,692,055			
Plus (minus) valía en Títulos Fiduciarios	957,929	776,153			
Valores Prestados	633,934	-			
Plus (Minus) valía de valores prestados	(48,580)	-			
Inversión en Fondos Mutuos	5,385,637	5,375,084			
Plus (Minus) valía de Fondos Mutuos	(844,735)	(67,313)			
	152,057,577	143,830,987			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	933,723	1,367,619			
Dividendos o derechos por cobrar	72	73			
Intereses devengados sobre valores	1,648,381	1,424,713			
Reportos	5,082,360	3,836,664			
Premios por cobrar por préstamo de valores	28	-			
Intereses devengados sobre valores prestados	11,924	-			
Reembolsos y otros intereses	120	136			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	1,161,077	2,434,740			
	8,837,685	9,063,946			
TOTAL ACTIVO	162,175,488	154,006,712			
			CAPITAL CONTABLE	2023	2022
			CAPITAL		
			CAPITAL CONTRIBUIDO	125,162,762	119,104,263
			Capital social pagado	131,134,629	125,885,818
			Prima en venta de acciones	(5,971,867)	(6,781,556)
			CAPITAL GANADO	31,414,438	26,283,703
			Resultados de ejercicios anteriores	28,561,501	24,172,472
			Resultados del ejercicio	2,852,937	2,111,232
			OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
			PLUS (MINUS) VALÍAS	1,730,966	4,353,977
			TOTAL CAPITAL CONTABLE	158,308,165	149,741,943
			TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	162,175,488	154,006,712

CUENTAS DE ORDEN	2023	2022	CUENTAS DE ORDEN	2023	2022
Valores entregados en custodia	151,391,311	143,764,033	Capital social autorizado	35,000,100	35,000,100
Valores prestados	585,355	-	Acciones emitidas	35,000,100,000	35,000,100,000
Garantías recibidas por valores prestados	619,597	0	Acciones en circulación, posición propia	70,550,704	70,213,429
Colaterales recibidos por reportos	5,084,240	3,837,505	Acciones de Siefores, posición de terceros	1	1
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	190,514	1,067,131	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	13,042,912,164	12,518,368,400
Bancos divisas en moneda extranjera	67,940	34,745			
Dólares americanos	31,683	34,318			
Euros	36,215	-			
Otras Divisas	42	427			
Divisas por recibir	-	21,176			
Dólares americanos	-	21,176			
Divisas por entregar	14,937	36,582			
Dólares americanos	14,937	36,582			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	5,572,836	6,497,737			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	78,963,062	112,679,135			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	22,867,018	24,779,734			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	7,373,956	11,295,532			
Contratos Adelantados sobre Euros	2,932,589	979,944			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	1,766,451	563,720			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	32,707,485	35,079,808			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	5,427,273	10,337,809			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	1,135,530	1,678,300			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	90,540	90,540			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	3,035,817	15,619,317			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	1,626,404	12,252,904			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	-	1,527			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	60,727,572	96,180,714			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	1,822,459	4,388,668			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	11,661,841	13,875,624			
Contratos Adelantados sobre Euros	125,377	1,523,433			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	2,660,897	899,221			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	2,385,900	14,969,400			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	2,131,983	13,561,348			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	1,792,702	1,792,702			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	266,123	266,123			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	31,883,592	33,996,963			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	5,906,157	10,816,692			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	90,540	90,540			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$ 1,730,966	\$ 4,353,977
Un valor de los activos netos de:	\$ 158,308,165	\$ 149,741,943
El precio de la acción de:	\$ 12.072186	\$ 11.895061

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 70-74, 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 31 DE MARZO DE 2023 Y 2022

(Cifras en miles de pesos)

	2023	2022
Ingresos por la venta de Valores	6,096,417	12,925,029
Intereses, dividendos, premios y derechos	2,079,139	2,276,190
Resultado cambiario / Otros productos	(312,454)	(25,564)
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	1,688,799	(399,057)
INGRESOS NETOS	9,551,902	14,776,599
Costo de ventas de valores	6,461,473	12,447,571
Gastos generales	9,561	8,509
Comisiones sobre saldos	221,776	202,308
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	6,155	6,980
EGRESOS NETOS	6,698,966	12,665,368
UTILIDAD DE OPERACIÓN	2,852,937	2,111,232
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	1,481,415	(4,706,915)
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	4,334,351	(2,595,684)

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 31 de Enero de 2023 fueron aprobados los Estados Financieros del 31 de Diciembre de 2022, asimismo los presentes Estados Financieros al 31 de Marzo de 2023 serán aprobados en la Sesión del Consejo de Administración con fecha 3 de Mayo de 2023