

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 2023 Y 2022

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2023	2022	PASIVO	2023	2022
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	10	8,352	Acreedores	364,979	735,415
Bancos monedas extranjeras	89,887	41,134	Provisiones para gastos	9,906	6,582
Divisas por recibir	466,831	91,398	Divisas por entregar	461,753	87,277
	556,728	140,883	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	3,303,043	5,289,682
RESERVADOS			TOTAL PASIVO	4,139,681	6,118,956
Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en divisas	-	20,704			
	-	20,704			
INVERSIONES			CAPITAL CONTABLE	2023	2022
Inversión en valores de renta variable	21,785,508	21,266,780	CAPITAL		
Plus (Minus) valia en valores de renta variable	(506,056)	(1,181,438)	CAPITAL CONTRIBUIDO	29,764,784	20,705,792
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	25,042,079	19,194,755	Capital social pagado	35,757,047	32,580,059
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos	1,716,214	1,215,527	Prima en venta de acciones	(5,992,264)	(11,874,267)
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	35,935,204	32,215,632			
Plus (Minus) valia en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(1,957,716)	(2,823,132)	CAPITAL GANADO	78,641,585	72,960,034
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	1,645,174	1,485,950	Resultados de ejercicios anteriores	74,865,510	74,614,971
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	(425,624)	(250,550)	Resultados del ejercicio	3,776,075	(1,654,938)
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	1,807,806	2,811,748			
Plus (Minus) valia instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	(11,322)	(53,628)	OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
Inversión en FIBRAS	3,052,776	2,184,239	PLUS (MINUS) VALÍAS	(1,584,001)	(3,164,911)
Plus (Minus) valia en Inversion en FIBRAS	(84,654)	(346,356)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	-	29,849	TOTAL CAPITAL CONTABLE	106,822,367	90,500,914
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	-	2,566			
Inversión en valores extranjeros de deuda	533,805	522,405			
Plus (Minus) valia en Inversión en valores extranjeros de deuda	(16,602)	(24,304)			
Inversión en títulos Fiduciarios	9,040,422	7,740,675			
Plus (minus) valia en Títulos Fiduciarios	565,835	907,746			
Valores Prestados	-	267,167			
Plus (Minus) valia de valores prestados	-	(51,117)			
Inversión en Fondos Mutuos	4,613,322	4,400,564			
Plus (Minus) valia de Fondos Mutuos	(864,075)	(557,661)			
	101,872,096	88,957,417			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	2,706	90,027			
Dividendos o derechos por cobrar	6,465	50			
Intereses devengados sobre valores	655,235	593,834			
Reportos	5,154,438	3,589,714			
Premios por cobrar por préstamo de valores	-	3			
Intereses devengados sobre valores prestados	-	1,222			
Reembolsos y otros intereses	118	106			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	2,714,262	3,225,909			
	8,533,224	7,500,865			
TOTAL ACTIVO	110,962,048	96,619,870	TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	110,962,048	96,619,870

CUENTAS DE ORDEN	2023	2022	CUENTAS DE ORDEN	2023	2022
Valores entregados en custodia	101,872,096	88,708,953	Capital social autorizado	126,259,200	126,259,200
Valores prestados	-	216,050	Acciones emitidas	25,000,019,801	25,000,019,801
Garantías recibidas por valores prestados	-	224,990	Acciones en circulación, posición propia	38,080,863	35,916,569
Colaterales recibidos por reportos	5,157,927	3,591,932	Acciones de Siefores, posición de terceros	2	2
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	424,858	221,212	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	7,042,012,271	6,415,115,310
Bancos divisas en moneda extranjera	5,158	2,110			
Dólares americanos	4,110	1,798			
Euros	1,006	-			
Otras Divisas	42	312			
Divisas por recibir	27,275	4,540			
Dólares americanos	27,275	4,540			
Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en moneda extranjera	-	1,028			
Dólares americanos	-	1,028			
Divisas por entregar	26,978	4,335			
Dólares americanos	26,978	4,335			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	3,521,299	4,103,146			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	90,328,801	121,167,502			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	18,799,926	20,922,587			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	9,236,127	6,243,077			
Contratos Adelantados sobre Euros	2,697,728	2,172,179			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	1,223,205	1,639,039			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	135,473	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	26,481,381	37,693,507			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	8,183,842	12,178,281			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	2,280,760	2,663,307			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	119,905	119,905			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	16,215,929	24,712,179			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	4,954,525	12,822,376			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	-	1,065			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	68,260,897	100,597,538			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	207,499	-			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	7,808,015	7,101,313			
Contratos Adelantados sobre Euros	1,028,514	2,090,210			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	942,218	1,312,324			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	15,236,153	23,732,403			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	4,732,865	13,466,076			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	2,179,600	2,179,600			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	123,685	123,685			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	26,515,310	37,110,450			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	9,367,134	13,361,573			
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:	-\$	1,584,001	-\$	3,164,911
Un valor de los activos netos de:	\$	106,822,367	\$	90,500,914
El precio de la acción de:	\$	15.087706	\$	14.028905

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 2023 Y 2022

(Cifras en miles de pesos)

	2023	2022
Ingresos por la venta de Valores	8,288,263	11,718,974
Intereses, dividendos, premios y derechos	2,842,386	2,590,778
Resultado cambiario / Otros productos	(146,027)	(30,271)
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	1,971,174	(4,529,102)
INGRESOS NETOS	12,955,795	9,750,380
Costo de ventas de valores	8,866,128	11,130,252
Gastos generales	10,892	10,650
Comisiones sobre saldos	293,127	253,637
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	9,573	10,778
EGRESOS NETOS	9,179,720	11,405,317
UTILIDAD DE OPERACIÓN	3,776,075	(1,654,938)
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	455,190	(6,902,379)
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	4,231,265	(8,557,317)

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