

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 SEPTIEMBRE DE 2023 Y 2022

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2023	2022	PASIVO	2023	2022
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	449	18	Acreedores	902,739	1,526,527
Bancos monedas extranjeras	646,411	59,536	Provisiones para gastos	10,469	9,744
Divisas por recibir	611	832,837	Divisas por entregar	-	855,080
	647,471	892,391	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	4,265,357	7,043,700
RESERVADOS			TOTAL PASIVO	5,178,566	9,435,051
Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en divisas	42,660	-			
	42,660	-			
INVERSIONES			CAPITAL CONTABLE	2023	2022
Inversión en valores de renta variable	23,602,155	23,161,014	CAPITAL		
Plus (Minus) valia en valores de renta variable	(1,173,888)	(3,147,601)	CAPITAL CONTRIBUIDO	33,208,695	23,623,632
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	25,200,330	20,262,000	Capital social pagado	36,924,426	33,644,162
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	485,781	634,922	Prima en venta de acciones	(3,715,731)	(10,020,530)
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	36,377,457	32,032,397	CAPITAL GANADO	78,350,739	72,330,275
Plus (Minus) valia en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(3,327,961)	(3,403,927)	Resultados de ejercicios anteriores	74,865,510	74,614,971
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	1,645,182	1,485,950	Resultados del ejercicio	3,485,229	(2,284,697)
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	(439,948)	(326,948)	OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	2,870,132	3,938,839	PLUS (MINUS) VALÍAS	(5,267,152)	(6,786,734)
Plus (Minus) valia instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	(127,148)	(65,771)	TOTAL CAPITAL CONTABLE	106,292,283	89,167,173
Inversión en FIBRAS	3,116,034	2,207,593			
Plus (Minus) valia en Inversion en FIBRAS	(50,112)	(326,373)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	3,354	9,600			
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	-	6,837			
Inversión en valores extranjeros de deuda	533,805	534,805			
Plus (Minus) valia en Inversión en valores extranjeros de deuda	(40,045)	(36,358)			
Inversión en títulos Fiduciarios	10,537,328	7,946,193			
Plus (minus) valia en Títulos Fiduciarios	274,352	803,530			
Valores Prestados	-	260,417			
Plus (Minus) valia de valores prestados	-	(20,590)			
Inversión en Fondos Mutuos	4,602,100	4,400,564			
Plus (Minus) valia de Fondos Mutuos	(868,183)	(897,617)			
	103,220,725	89,459,478			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	1,887	507			
Dividendos o derechos por cobrar	9,252	10,586			
Intereses devengados sobre valores	1,071,234	871,462			
Reportos	3,611,678	3,431,086			
Premios por cobrar por préstamo de valores	-	42			
Intereses devengados sobre valores prestados	-	1,389			
Reembolsos y otros intereses	129	100			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	2,865,811	3,935,182			
	7,559,992	8,250,355			
TOTAL ACTIVO	111,470,849	98,602,224	TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	111,470,849	98,602,224

CUENTAS DE ORDEN	2023	2022	CUENTAS DE ORDEN	2023	2022
Valores entregados en custodia	103,217,371	89,203,213	Capital social autorizado	126,259,200	126,259,200
Valores prestados	-	239,827	Acciones emitidas	25,000,019,801	25,000,019,801
Garantías recibidas por valores prestados	-	246,631	Acciones en circulación, posición propia	38,362,620	35,876,794
Colaterales recibidos por reportos	3,616,477	3,431,351	Acciones de Siefores, posición de terceros	2	2
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	156,412	286,239	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	7,272,877,880	6,625,853,358
Bancos divisas en moneda extranjera	35,224	3,037			
Dólares americanos	2,411	2,754			
Euros	32,777	-			
Otras Divisas	37	283			
Divisas por recibir	35	41,450			
Dólares americanos	35	41,450			
Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en moneda extranjera	2,448	-			
Dólares americanos	2,448	-			
Divisas por entregar	-	42,557			
Dólares americanos	-	42,557			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	3,471,079	3,895,453			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	96,486,999	122,315,732			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	21,723,591	22,769,329			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	11,486,171	9,700,553			
Contratos Adelantados sobre Euros	369,512	499,359			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	2,371,486	2,068,362			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	230,931	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	28,487,981	38,239,016			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	8,991,107	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	15,471,029	21,254,179			
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	75,572,304	102,989,137			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	1,615,938	1,489,955			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	11,821,218	11,414,246			
Contratos Adelantados sobre Euros	-	871,428			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	1,791,531	2,031,872			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	14,491,253	20,274,403			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	4,732,865	13,285,766			
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	28,521,910	37,836,705			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	10,174,400	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:	-\$	5,267,152	-\$	6,786,734
Un valor de los activos netos de:	\$	106,292,283	\$	89,167,173
El precio de la acción de:	\$	14.538201	\$	13.384987

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 SEPTIEMBRE DE 2023 Y 2022**

(Cifras en miles de pesos)

	2023	2022
Ingresos por la venta de Valores	12,907,610	17,984,920
Intereses, dividendos, premios y derechos	4,148,410	3,743,503
Resultado cambiario / Otros productos	(192,338)	(32,403)
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	542,897	(5,959,767)
INGRESOS NETOS	17,406,579	15,736,253
Costo de ventas de valores	13,446,495	17,596,710
Gastos generales	15,136	17,976
Comisiones sobre saldos	445,621	390,327
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	14,098	15,936
EGRESOS NETOS	13,921,350	18,020,950
UTILIDAD DE OPERACIÓN	3,485,229	(2,284,697)
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(3,227,961)	(10,524,202)
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	257,268	(12,808,899)

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