

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

**SIEFORE SURA BASICA 90-94, 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	14	10	Acreedores	1,014,129	2,487
Bancos monedas extranjeras	29,242	26,646	Provisiones para gastos	5,232	4,467
Divisas por recibir	482,220	-	Divisas por entregar	487,305	96,007
	511,476	26,657	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	2,439,284	824,700
INVERSIONES			TOTAL PASIVO	3,945,951	927,662
Inversión en valores de renta variable	13,340,972	8,570,248			
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	(1,840,710)	737,411			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	10,963,149	8,508,199			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	215,650	779,342			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	18,242,161	17,966,186			
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(2,018,708)	(383,063)			
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	774,648	694,845			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	(174,469)	99,879			
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	2,338,880	382,389	CAPITAL		
Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	(19,925)	7,833	CAPITAL CONTRIBUIDO	47,449,923	38,062,353
Inversión en FIBRAS	1,194,255	980,911	Capital social pagado	46,303,336	38,231,965
Plus (Minus) valía en Inversión en FIBRAS	(160,615)	(121,067)	Prima en venta de acciones	1,146,586	(169,612)
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	5,751	1,675	CAPITAL GANADO	6,449,565	6,325,481
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	3,172	22	Resultados de ejercicios anteriores	7,730,812	2,800,827
Inversión en valores extranjeros de deuda	174,476	34,621	Resultados del ejercicio	(1,281,247)	3,524,654
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	(12,755)	2,015	OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
Inversión en títulos Fiduciarios	4,211,778	3,147,150	PLUS (MINUS) VALÍAS	(4,128,499)	1,414,771
Plus (minus) valía en Títulos Fiduciarios	389,162	96,258			
Valores Prestados	259,822	-	TOTAL CAPITAL CONTABLE	49,770,989	45,802,605
Plus (Minus) valía de valores prestados	(19,994)	-			
Inversión en Fondos Mutuos	2,313,387	2,295,943			
Plus (Minus) valía de Fondos Mutuos	(486,135)	196,162			
	49,693,951	43,996,960			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	243	122,279			
Dividendos o derechos por cobrar	5,994	5,476			
Intereses devengados sobre valores	492,254	345,091			
Reportos	2,483,326	1,596,569			
Premios por cobrar por préstamo de valores	42	-			
Intereses devengados sobre valores prestados	1,389	-			
Reembolsos y otros intereses	1,171	621			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	527,093	636,614			
	3,511,513	2,706,650			
TOTAL ACTIVO	53,716,941	46,730,266	TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	53,716,941	46,730,266

CUENTAS DE ORDEN	2022	2021	CUENTAS DE ORDEN	2022	2021
Valores entregados en custodia	49,300,802	43,842,663	Capital social autorizado	35,000,100	35,000,100
Valores prestados	239,827	-	Acciones emitidas	35,000,100,000	35,000,100,000
Garantías recibidas por valores prestados	248,779	-	Acciones en circulación, posición propia	20,157,736	19,152,969
Colaterales recibidos por reportos	2,483,565	1,595,926	Acciones de Siefores, posición de terceros	1	1
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	60,760	235,670	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	3,724,094,494	3,072,419,470
Bancos divisas en moneda extranjera	1,505	1,296			
Dólares americanos	1,317	1,295			
Otras Divisas	187	-			
Divisas por recibir	24,000	-			
Dólares americanos	24,000	-			
Divisas por entregar	24,253	4,669			
Dólares americanos	24,253	4,669			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	1,927,146	2,381,471			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	36,556,442	37,396,564			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	13,381,300	10,722,289			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	5,497,410	3,658,485			
Contratos Adelantados sobre Euros	287,669	511,297			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	1,221,708	824,218			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	-	117,461			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	11,203,356	7,354,756			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	1,042,870	3,548,213			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	336,393	542,819			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	48,941	48,941			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	3,196,125	5,808,125			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	340,176	4,259,465			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	494	494			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	25,207,977	28,163,248			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	872,920	1,759,004			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	6,177,490	4,264,527			
Contratos Adelantados sobre Euros	502,085	224,870			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	1,294,214	194,548			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	2,586,550	5,198,550			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	840,874	4,760,164			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	702,414	702,414			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	62,888	62,888			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	10,955,814	7,278,214			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	1,163,786	3,669,129			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	48,941	48,941			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	-\$	4,128,499	\$	1,414,771
Un valor de los activos netos de:	\$	49,770,989	\$	45,802,605
El precio de la acción de:	\$	13.292638	\$	14.815310

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 90-94, 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	9,955,416	14,251,201
Intereses, dividendos, premios y derechos	2,029,499	1,482,062
Resultado cambiario / Otros productos	2,790	7,384
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	(3,354,426)	1,037,619
INGRESOS NETOS	8,633,278	16,778,266
Costo de ventas de valores	9,683,113	12,977,271
Gastos generales	10,427	9,174
Comisiones sobre saldos	212,697	257,991
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	8,289	9,176
EGRESOS NETOS	9,914,526	13,253,612
UTILIDAD DE OPERACIÓN	(1,281,247)	3,524,654
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(5,865,134)	(1,608,052)
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	(7,146,381)	1,916,602

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