

**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 2023 Y 2022**

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2023	2022	PASIVO	2023	2022
<b>DISPONIBLE</b>			<b>OBLIGACIONES</b>		
Bancos moneda nacional	267	14	Acreedores	1,010,496	1,014,129
Bancos monedas extranjeras	694,506	29,242	Provisiones para gastos	5,871	5,232
Divisas por recibir	-	482,220	Divisas por entregar	-	487,305
	<b>694,773</b>	<b>511,476</b>	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	1,153,143	2,439,284
<b>RESERVADOS</b>			<b>TOTAL PASIVO</b>	<b>2,169,510</b>	<b>3,945,951</b>
Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en divisas	39,155	-			
	<b>39,155</b>	<b>-</b>			
<b>INVERSIONES</b>			<b>CAPITAL CONTABLE</b>	<b>2023</b>	<b>2022</b>
Inversión en valores de renta variable	14,099,079	13,340,972	<b>CAPITAL</b>		
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	(747,873)	(1,840,710)	<b>CAPITAL CONTRIBUIDO</b>	<b>56,265,719</b>	<b>47,449,923</b>
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	15,066,355	10,963,149	Capital social pagado	53,732,260	46,303,336
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	170,580	215,650	Prima en venta de acciones	2,533,459	1,146,586
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	21,880,700	18,242,161	<b>CAPITAL GANADO</b>	<b>9,874,725</b>	<b>6,449,565</b>
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(2,090,948)	(2,018,708)	Resultados de ejercicios anteriores	7,804,253	7,730,812
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	983,964	774,648	Resultados del ejercicio	2,070,472	(1,281,247)
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	(252,217)	(174,469)	<b>OTROS RESULTADOS INTEGRALES</b>		
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	1,707,251	2,338,880	PLUS (MINUS) VALÍAS	(3,347,199)	(4,128,499)
Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	(21,015)	(19,925)	<b>TOTAL CAPITAL CONTABLE</b>	<b>62,793,245</b>	<b>49,770,989</b>
Inversión en FIBRAS	1,758,465	1,194,255			
Plus (Minus) valía en Inversión en FIBRAS	1,792	(160,615)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	-	5,751			
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	-	3,172			
Inversión en valores extranjeros de deuda	173,476	174,476			
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	(15,141)	(12,755)			
Inversión en títulos Fiduciarios	5,948,918	4,211,778			
Plus (minus) valía en Títulos Fiduciarios	77,123	389,162			
Valores Prestados	-	259,822			
Plus (Minus) valía de valores prestados	-	(19,994)			
Inversión en Fondos Mutuos	2,463,758	2,313,387			
Plus (Minus) valía de Fondos Mutuos	(469,500)	(486,135)			
	<b>60,734,768</b>	<b>49,693,951</b>			
<b>DEUDORES DIVERSOS</b>					
Liquidadora	174,435	243			
Dividendos o derechos por cobrar	5,401	5,994			
Intereses devengados sobre valores	660,671	492,254			
Reportos	2,305,200	2,483,326			
Premios por cobrar por préstamo de valores	-	42			
Intereses devengados sobre valores prestados	-	1,389			
Reembolsos y otros intereses	72	1,171			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	348,280	527,093			
	<b>3,494,059</b>	<b>3,511,513</b>			
<b>TOTAL ACTIVO</b>	<b>64,962,755</b>	<b>53,716,941</b>	<b>TOTAL PASIVO MAS CAPITAL</b>	<b>64,962,755</b>	<b>53,716,941</b>

CUENTAS DE ORDEN	2023	2022	CUENTAS DE ORDEN	2023	2022
Valores entregados en custodia	60,734,768	49,300,802	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	22,834,065	20,157,736
Colaterales recibidos por reportos	2,308,779	2,483,565	Acciones de Siefores, posición de terceros	1	1
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	58,555	60,760	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	4,322,147,290	3,724,094,494
Bancos divisas en moneda extranjera	37,791	1,505			
Dólares americanos	1,526	1,317			
Euros	36,240	-			
Otras Divisas	25	187			
Divisas por recibir	-	24,000			
Dólares americanos	-	24,000			
Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en moneda extranjera	2,247	-			
Dólares americanos	2,247	-			
Divisas por entregar	-	24,253			
Dólares americanos	-	24,253			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	1,755,377	1,927,146			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	34,065,417	36,556,442			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	14,003,823	13,381,300			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	6,620,923	5,497,410			
Contratos Adelantados sobre Euros	413,821	287,669			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	1,356,711	1,221,708			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	304,893	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	7,248,005	11,203,356			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	2,317,912	1,042,870			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	163,629	336,393			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	48,941	48,941			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	1,465,275	3,196,125			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	121,483	340,176			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	-	494			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	20,384,045	25,207,977			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	1,071,728	872,920			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	6,451,363	6,177,490			
Contratos Adelantados sobre Euros	-	502,085			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	1,241,943	1,294,214			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	855,700	2,586,550			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	466,506	840,874			
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	7,043,734	10,955,814			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	2,438,829	1,163,786			
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:	-\$	3,347,199	-\$	4,128,499
Un valor de los activos netos de:	\$	62,793,245	\$	49,770,989
El precio de la acción de:	\$	14.451902	\$	13.292638

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 2023 Y 2022**

(Cifras en miles de pesos)

	2023	2022
Ingresos por la venta de Valores	7,675,860	9,955,416
Intereses, dividendos, premios y derechos	2,423,268	2,029,499
Resultado cambiario / Otros productos	(133,023)	2,790
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	399,838	(3,354,426)
<b>INGRESOS NETOS</b>	<b>10,365,943</b>	<b>8,633,278</b>
Costo de ventas de valores	8,021,071	9,683,113
Gastos generales	9,322	10,427
Comisiones sobre saldos	257,716	212,697
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	7,361	8,289
<b>EGRESOS NETOS</b>	<b>8,295,471</b>	<b>9,914,526</b>
<b>UTILIDAD DE OPERACIÓN</b>	<b>2,070,472</b>	<b>(1,281,247)</b>
<b>OTROS RESULTADOS INTEGRALES</b>		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(1,982,820)	(5,865,134)
<b>UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO</b>	<b>87,652</b>	<b>(7,146,381)</b>

\_\_\_\_\_  
**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