

**COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO**

**SIEFORE SURA BASICA INICIAL, 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
<b>DISPONIBLE</b>			<b>OBLIGACIONES</b>		
Bancos moneda nacional	11	10	Acreedores	380,650	1,478
Bancos monedas extranjeras	23,010	22,476	Provisiones para gastos	1,421	1,100
Divisas por recibir	152,703	-	Divisas por entregar	156,148	27,938
	<b>175,724</b>	<b>22,486</b>	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	713,736	212,059
<b>INVERSIONES</b>			<b>TOTAL PASIVO</b>	<b>1,251,956</b>	<b>242,574</b>
Inversión en valores de renta variable	4,436,278	2,380,069			
Plus (Minus) valia en valores de renta variable	(613,027)	172,838			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	3,163,095	2,388,232			
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	7,937	157,488			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	5,606,363	4,936,551			
Plus (Minus) valia en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(512,318)	(82,220)			
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	153,423	131,834			
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	(32,281)	20,323			
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	687,441	122,910			
Plus (Minus) valia instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	(13,232)	5,602			
Inversión en FIBRAS	369,186	250,213			
Plus (Minus) valia en Inversion en FIBRAS	(30,658)	(22,925)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	1,986	786			
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	682	5			
Inversión en valores extranjeros de deuda	17,239	8,239			
Plus (Minus) valia en Inversión en valores extranjeros de deuda	(1,407)	(199)			
Inversión en títulos Fiduciarios	1,131,229	806,863			
Plus (minus) valia en Títulos Fiduciarios	58,288	(13,683)			
Inversión en Fondos Mutuos	569,019	556,201			
Plus (Minus) valia de Fondos Mutuos	(123,466)	41,222			
	<b>14,875,779</b>	<b>11,860,350</b>			
<b>DEUDORES DIVERSOS</b>					
Liquidadora	70	13,858			
Dividendos o derechos por cobrar	1,717	1,416			
Intereses devengados sobre valores	140,359	84,926			
Reportos	1,214,855	383,997			
Reembolsos y otros intereses	206	37			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	164,764	158,851			
	<b>1,521,970</b>	<b>643,085</b>			
<b>TOTAL ACTIVO</b>	<b>16,573,474</b>	<b>12,525,921</b>			
			<b>CAPITAL CONTABLE</b>	<b>2022</b>	<b>2021</b>
			<b>CAPITAL</b>		
			<b>CAPITAL CONTRIBUIDO</b>	<b>15,142,791</b>	<b>10,530,507</b>
			Capital social pagado	14,279,332	10,282,078
			Prima en venta de acciones	863,459	248,428
			<b>CAPITAL GANADO</b>	<b>1,438,892</b>	<b>1,474,392</b>
			Resultados de ejercicios anteriores	1,852,439	607,453
			Resultados del ejercicio	(413,547)	866,939
			<b>OTROS RESULTADOS INTEGRALES</b>		
			PLUS (MINUS) VALÍAS	(1,260,165)	278,447
			<b>TOTAL CAPITAL CONTABLE</b>	<b>15,321,518</b>	<b>12,283,346</b>
			<b>TOTAL PASIVO MAS CAPITAL</b>	<b>16,573,474</b>	<b>12,525,921</b>

CUENTAS DE ORDEN	2022	2021	CUENTAS DE ORDEN	2022	2021
Valores entregados en custodia	14,848,710	11,844,959	Capital social autorizado	35,000,100	35,000,100
Colaterales recibidos por reportos	1,215,182	384,166	Acciones emitidas	35,000,100,000	35,000,100,000
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	13,482	84,516	Acciones en circulación, posición propia	6,220,404	5,230,606
Bancos divisas en moneda extranjera	1,162	1,093	Acciones de Siefores, posición de terceros	1	1
Dólares americanos	1,099	1,093	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	1,148,457,063	826,214,764
Otras Divisas	63	-			
Divisas por recibir	7,600	-			
Dólares americanos	7,600	-			
Divisas por entregar	7,771	1,359			
Dólares americanos	7,771	1,359			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	580,978	729,160			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	11,435,301	9,001,092			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	3,980,829	2,878,387			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	1,897,868	1,001,412			
Contratos Adelantados sobre Euros	89,355	130,221			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	433,306	197,338			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	-	64,681			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	3,058,227	1,498,727			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	549,829	784,238			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	184,912	184,912			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	9,788	9,788			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	907,484	1,272,984			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	323,596	978,299			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	106	106			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	8,101,345	6,454,585			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	215,949	449,964			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	2,100,358	1,080,162			
Contratos Adelantados sobre Euros	157,031	54,665			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	532,748	79,425			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	728,300	1,093,800			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	426,588	1,081,290			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	156,008	156,008			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	13,421	13,421			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	3,143,856	1,584,356			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	617,297	851,705			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	9,788	9,788			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	-\$	1,260,165	\$	278,447
Un valor de los activos netos de:	\$	15,321,518	\$	12,283,346
El precio de la acción de:	\$	13.269089	\$	14.773485

**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 INICIAL, 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)

	<b>2022</b>	<b>2021</b>
Ingresos por la venta de Valores	3,769,042	4,734,864
Intereses, dividendos, premios y derechos	565,284	371,436
Resultado cambiario / Otros productos	3,335	405
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	<b>(966,438)</b>	250,358
<b>INGRESOS NETOS</b>	<b>3,371,223</b>	<b>5,357,062</b>
Costo de ventas de valores	3,718,021	4,418,808
Gastos generales	3,500	2,631
Comisiones sobre saldos	61,240	66,534
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	2,008	2,149
<b>EGRESOS NETOS</b>	<b>3,784,770</b>	<b>4,490,123</b>
<b>UTILIDAD DE OPERACIÓN</b>	<b>(413,547)</b>	<b>866,939</b>
<b>OTROS RESULTADOS INTEGRALES</b>		
PLUS (MINUS) VALÍAS	<b>(1,627,866)</b>	<b>(368,875)</b>
<b>UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO</b>	<b>(2,041,413)</b>	<b>498,064</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 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