

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 2023 Y 2022

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2023	2022	PASIVO	2023	2022
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	106	11	Acreedores	397,699	380,650
Bancos monedas extranjeras	231,481	23,010	Provisiones para gastos	1,772	1,421
Divisas por recibir	-	152,703	Divisas por entregar	-	156,148
	231,587	175,724	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	358,756	713,736
RESERVADOS			TOTAL PASIVO	758,227	1,251,956
Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en divisas	89,083	-			
	89,083	-			
INVERSIONES			CAPITAL CONTABLE	2023	2022
Inversión en valores de renta variable	5,057,932	4,436,278	CAPITAL		
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	(282,025)	(613,027)	CAPITAL CONTRIBUIDO	19,879,466	15,142,791
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	4,627,492	3,163,095	Capital social pagado	18,271,658	14,279,332
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	(7,136)	7,937	Prima en venta de acciones	1,607,807	863,459
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	8,199,882	5,606,363	CAPITAL GANADO	2,523,638	1,438,892
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(540,076)	(512,318)	Resultados de ejercicios anteriores	1,787,089	1,852,439
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	342,485	153,423	Resultados del ejercicio	736,549	(413,547)
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	(70,838)	(32,281)	OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	515,145	687,441	PLUS (MINUS) VALÍAS	(1,057,855)	(1,260,165)
Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	(12,586)	(13,232)			
Inversión en FIBRAS	576,848	369,186	TOTAL CAPITAL CONTABLE	21,345,249	15,321,518
Plus (Minus) valía en Inversión en FIBRAS	5,954	(30,658)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	-	1,986			
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	-	682			
Inversión en valores extranjeros de deuda	17,239	17,239			
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	(1,392)	(1,407)			
Inversión en títulos Fiduciarios	1,650,255	1,131,229			
Plus (minus) valía en Títulos Fiduciarios	(29,616)	58,288			
Inversión en Fondos Mutuos	639,805	569,019			
Plus (Minus) valía de Fondos Mutuos	(120,140)	(123,466)			
	20,569,228	14,875,779			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	62,072	70			
Dividendos o derechos por cobrar	1,665	1,717			
Intereses devengados sobre valores	227,292	140,359			
Reportos	803,247	1,214,855			
Reembolsos y otros intereses	20	206			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	119,282	164,764			
	1,213,578	1,521,970			
TOTAL ACTIVO	22,103,475	16,573,474	TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	22,103,475	16,573,474

CUENTAS DE ORDEN	2023	2022	CUENTAS DE ORDEN	2023	2022
Valores entregados en custodia	20,569,228	14,848,710	Capital social autorizado	35,000,100	35,000,100
Colaterales recibidos por reportos	804,499	1,215,182	Acciones emitidas	35,000,100,000	35,000,100,000
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	5,011	13,482	Acciones en circulación, posición propia	7,846,334	6,220,404
Bancos divisas en moneda extranjera	12,627	1,162	Acciones de Siefores, posición de terceros	1	1
Dólares americanos	1,042	1,099	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	1,469,664,825	1,148,457,063
Euros	11,570	-			
Otras Divisas	15	63			
Divisas por recibir	-	7,600			
Dólares americanos	-	7,600			
Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en moneda extranjera	5,112	-			
Dólares americanos	5,112	-			
Divisas por entregar	-	7,771			
Dólares americanos	-	7,771			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	545,863	580,978			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	11,594,857	11,435,301			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	4,927,003	3,980,829			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	2,393,712	1,897,868			
Contratos Adelantados sobre Euros	157,527	89,355			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	423,047	433,306			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	173,465	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	1,536,024	3,058,227			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	887,371	549,829			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	153,742	184,912			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	9,788	9,788			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	782,584	907,484			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	150,595	323,596			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	-	106			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	6,558,100	8,101,345			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	317,972	215,949			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	2,130,023	2,100,358			
Contratos Adelantados sobre Euros	-	157,031			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	525,701	532,748			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	603,400	728,300			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	205,313	426,588			
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	1,641,636	3,143,856			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	954,838	617,297			
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:	-\$	1,057,855	-\$	1,260,165
Un valor de los activos netos de:	\$	21,345,249	\$	15,321,518
El precio de la acción de:	\$	14.446760	\$	13.269089

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 2023 Y 2022

(Cifras en miles de pesos)

	2023	2022
Ingresos por la venta de Valores	2,786,633	3,769,042
Intereses, dividendos, premios y derechos	814,869	565,284
Resultado cambiario / Otros productos	(63,523)	3,335
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	173,771	(966,438)
INGRESOS NETOS	3,711,750	3,371,223
Costo de ventas de valores	2,885,659	3,718,021
Gastos generales	3,288	3,500
Comisiones sobre saldos	84,448	61,240
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	1,807	2,008
EGRESOS NETOS	2,975,201	3,784,770
UTILIDAD DE OPERACIÓN	736,549	(413,547)
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(724,410)	(1,627,866)
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	12,139	(2,041,413)

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