

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

**SIEFORE SURA BASICA 70-74, 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 JUNIO DE 2022 Y 2021**

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO		2022	2021	PASIVO		2022	2021
<b>DISPONIBLE</b>				<b>OBLIGACIONES</b>			
Bancos moneda nacional		13,279	10	Acreedores		907,968	683,401
Bancos monedas extranjeras		63,106	33,085	Provisiones para gastos		8,671	11,105
Divisas por recibir		183,416	244,175	Divisas por entregar		185,758	-
		<b>259,802</b>	<b>277,271</b>	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)		3,399,569	2,111,249
<b>INVERSIONES</b>				<b>TOTAL PASIVO</b>		<b>4,501,966</b>	<b>2,805,755</b>
Inversión en valores de renta variable		26,209,957	20,136,695				
Plus (Minus) valia en valores de renta variable		(1,418,965)	2,386,955				
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís		39,750,294	31,813,285				
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís		4,972,720	5,733,443				
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos		48,082,048	44,449,374				
Plus (Minus) valia en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos		(4,008,446)	102,790				
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso		2,935,359	3,298,855				
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso		(223,583)	604,228				
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas		3,624,720	1,084,133				
Plus (Minus) valia instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas		(39,335)	83,302				
Inversión en FIBRAS		4,194,205	4,123,284				
Plus (Minus) valia en Inversion en FIBRAS		(899,077)	(768,040)				
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados		68,802	5,631				
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)		3,680	26				
Inversión en valores extranjeros de deuda		707,413	320,649				
Plus (Minus) valia en Inversión en valores extranjeros de deuda		(38,842)	14,191				
Inversión en títulos Fiduciarios		11,926,573	9,694,105				
Plus (minus) valia en Títulos Fiduciarios		1,097,891	105,192				
Valores Prestados		732,811	1,050,212				
Plus (Minus) valia de valores prestados		(69,670)	36,521				
Inversión en Fondos Mutuos		5,375,084	5,396,594				
Plus (Minus) valia de Fondos Mutuos		(627,718)	591,013				
		<b>142,355,921</b>	<b>130,262,438</b>				
<b>DEUDORES DIVERSOS</b>							
Liquidadora		58,786	145,725				
Div dendos o derechos por cobrar		90	2,174				
Intereses devengados sobre valores		954,692	871,723				
Reportos		4,573,013	9,735,640				
Premios por cobrar por préstamo de valores		8	41				
Intereses devengados sobre valores prestados		3,560	4,835				
Reembolsos y otros intereses		130	-				
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)		1,114,584	1,523,286				
		<b>6,704,864</b>	<b>12,283,424</b>				
<b>TOTAL ACTIVO</b>		<b>149,320,586</b>	<b>142,823,133</b>				
				<b>CAPITAL CONTABLE</b>		<b>2022</b>	<b>2021</b>
				<b>CAPITAL</b>			
				<b>CAPITAL CONTRIBUIDO</b>		<b>121,368,474</b>	<b>112,399,884</b>
				Capital soc al pagado		127,869,296	120,222,621
				Prima en venta de acciones		(6,500,821)	(7,822,737)
				<b>CAPITAL GANADO</b>		<b>24,705,171</b>	<b>18,727,900</b>
				Resultados de ejercicios anteriores		24,172,472	11,143,336
				Resultados del ejercicio		532,699	7,584,564
				<b>OTROS RESULTADOS INTEGRALES</b>			
				PLUS (MINUS) VALÍAS		(1,255,025)	8,889,594
				<b>TOTAL CAPITAL CONTABLE</b>		<b>144,818,620</b>	<b>140,017,378</b>
				<b>TOTAL PASIVO MAS CAPITAL</b>		<b>149,320,586</b>	<b>142,823,133</b>

CUENTAS DE ORDEN	2022	2021	CUENTAS DE ORDEN	2022	2021
Valores entregados en custodia	141,614,898	129,170,048	Capital social autorizado	35,000,100	35,000,100
Valores prestados	663,141	1,086,733	Acciones emitidas	35,000,100,000	35,000,100,000
Garantías recibidas por valores prestados	698,715	1,120,422	Acciones en circulación, posición propia	71,267,688	74,482,385
Colaterales recibidos por reportos	4,574,432	9,729,537	Acciones de Siefores, posición de terceros	1	1
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	89,783	348,512	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	12,715,661,887	11,947,779,712
Bancos divisas en moneda extranjera	3,228	1,662			
Dólares americanos	2,796	1,662			
Otras Divisas	432	-			
Divisas por recibir	9,110	12,266			
Dólares americanos	9,110	12,266			
Divisas por entregar	9,226	-			
Dólares americanos	9,226	-			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	6,387,744	7,541,891			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	99,538,804	101,343,516			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	20,004,539	19,225,702			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	6,644,197	6,711,458			
Contratos Adelantados sobre Euros	2,140,702	7,764,929			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	1,253,762	1,902,759			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	41,052,008	18,766,808			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	7,188,430	13,509,460			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	1,135,530	1,889,555			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	90,540	90,540			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	15,619,317	12,644,317			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	4,408,252	18,712,205			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	1,527	125,783			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	86,589,496	87,914,379			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	-	1,306,035			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	12,042,251	11,797,566			
Contratos Adelantados sobre Euros	2,217,604	6,993,270			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	2,308,674	1,805,787			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	14,969,400	11,994,400			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	5,716,696	20,020,649			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	1,792,702	1,792,702			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	266,123	266,123			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	39,518,192	17,858,963			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	7,667,314	13,988,343			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	90,540	90,540			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	-\$	1,255,025	\$	8,889,594
Un valor de los activos netos de:	\$	144,818,620	\$	140,017,378
El precio de la acción de:	\$	11.325519	\$	11.646509

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 70-74, 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 JUNIO DE 2022 Y 2021**

(Cifras en miles de pesos)

	<b>2022</b>	<b>2021</b>
Ingresos por la venta de Valores	19,446,566	24,657,695
Intereses, dividendos, premios y derechos	4,380,461	3,353,563
Resultado cambiario / Otros productos	(6,760)	(45,809)
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	(3,939,804)	2,131,749
<b>INGRESOS NETOS</b>	<b>19,880,462</b>	<b>30,097,198</b>
Costo de ventas de valores	18,909,303	21,925,087
Gastos generales	15,270	15,285
Comisiones sobre saldos	409,821	557,259
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	13,369	15,003
<b>EGRESOS NETOS</b>	<b>19,347,763</b>	<b>22,512,634</b>
<b>UTILIDAD DE OPERACIÓN</b>	<b>532,699</b>	<b>7,584,564</b>
<b>OTROS RESULTADOS INTEGRALES</b>		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(10,315,917)	(4,271,731)
<b>UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO</b>	<b>(9,783,218)</b>	<b>3,312,833</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.