

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO
SIEFORE SURA BASICA 55-59, S.A. DE C.V., SOCIEDAD DE INVERSIÓN ESPECIALIZADA DE FONDOS PARA EL RETIRO
SOCIEDAD DE INVERSIÓN BÁSICA
ESTADO DE SITUACIÓN FINANCIERA AL 31 DE MARZO DE 2023 Y 2022

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2023	2022	PASIVO	2023	2022
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	10	10	Acreedores	40,669	316,775
Bancos monedas extranjeras	46,128	18,717	Provisiones para gastos	900	458
Divisas por recibir	4,471	6,102	Divisas por entregar	-	2,292
	50,609	24,829	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	733,744	843,557
INVERSIONES			TOTAL PASIVO	775,312	1,163,082
Inversión en valores de renta variable	1,267,418	1,088,812			
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	(53,500)	54,087			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	5,916,315	7,632,923			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	1,141,278	1,586,174			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	5,293,543	5,092,295			
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(274,836)	(284,384)			
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	571,827	323,838			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	(46,850)	30,445			
Inversión en Depósito Banxico	9,756	6,530			
Plus (Minus) valía en Depósito Banxico	163	125			
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	590,910	531,193			
Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	25,249	13,522			
Inversión en FIBRAS	326,316	595,966			
Plus (Minus) valía en Inversión en FIBRAS	(11,590)	(111,972)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	5,209	5,488			
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	-	290			
Inversión en valores extranjeros de deuda	104,591	141,591			
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	(1,550)	22,310			
Valores Prestados	147,383	-			
Plus (Minus) valía de valores prestados	(14,436)	-			
Inversión en Fondos Mutuos	141,683	138,739			
Plus (Minus) valía de Fondos Mutuos	(19,536)	1,683			
	15,119,343	16,869,656			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	28,407	170,169			
Dividendos o derechos por cobrar	2	2			
Intereses devengados sobre valores	217,582	230,798			
Reportos	299,079	424,122			
Premios por cobrar por préstamo de valores	6	-			
Intereses devengados sobre valores prestados	3,698	-			
Reembolsos y otros intereses	3,208	1,406			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	485,045	582,931			
	1,037,027	1,409,428			
TOTAL ACTIVO	16,206,979	18,303,913			
			CAPITAL CONTABLE	2023	2022
			CAPITAL		
			CAPITAL CONTRIBUIDO	(1,311,158)	1,122,422
			Capital social pagado	4,532,450	5,281,249
			Prima en venta de acciones	(5,843,608)	(4,158,826)
			CAPITAL GANADO	15,998,432	14,706,419
			Resultados de ejercicios anteriores	15,689,156	14,472,293
			Resultados del ejercicio	309,276	234,126
			OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
			PLUS (MINUS) VALÍAS	744,392	1,311,990
			TOTAL CAPITAL CONTABLE	15,431,667	17,140,831
			TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	16,206,979	18,303,913

CUENTAS DE ORDEN	2023	2022	CUENTAS DE ORDEN	2023	2022
Valores entregados en custodia	14,695,388	16,607,279	Capital social autorizado	11,354,689	11,354,689
Valores prestados	132,947	-	Acciones emitidas	3,200,028,183	3,200,028,183
Garantías recibidas por valores prestados	141,567	0	Acciones en circulación, posición propia	7,684,121	8,601,131
Colaterales recibidos por reportos	299,154	424,200	Acciones de Siefores, posición de terceros	1,127	1,127
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	173,107	165,970	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	1,269,669,762	1,479,782,360
Bancos divisas en moneda extranjera	2,484	943			
Dólares americanos	1,558	929			
Euros	914	-			
Otras Divisas	12	14			
Divisas por recibir	248	306			
Dólares americanos	248	306			
Divisas por entregar	-	115			
Dólares americanos	-	115			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	11,790,279	19,761,120			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	228,940	342,180			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	340,532	575,490			
Contratos Adelantados sobre Euros	58,980	144,617			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	42,678	11,738			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	-	216,650			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	5,809,651	10,035,742			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	680,807	542,597			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	934,034	1,201,498			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	36,706	36,706			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	3,540,518	6,531,746			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	117,434	117,434			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	-	4,722			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	11,942,207	19,300,675			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	-	67,915			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	704,546	686,546			
Contratos Adelantados sobre Euros	2,427	47,988			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	86,620	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	2,623,227	5,597,077			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	304,873	481,035			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	888,555	906,062			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	17,229	81,495			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	6,468,863	10,724,899			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	809,162	670,952			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	36,706	36,706			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$	744,392	\$	1,311,990
Un valor de los activos netos de:	\$	15,431,667	\$	17,140,831
El precio de la acción de:	\$	12.080954	\$	11.516399

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 55-59, 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 31 DE MARZO DE 2023 Y 2022

(Cifras en miles de pesos)

	2023	2022
Ingresos por la venta de Valores	1,361,026	2,173,424
Intereses, dividendos, premios y derechos	227,124	239,406
Resultado cambiario / Otros productos	(9,835)	(7,785)
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	88,516	(37,174)
INGRESOS NETOS	1,666,830	2,367,871
Costo de ventas de valores	1,334,408	2,108,845
Gastos generales	856	684
Comisiones sobre saldos	22,122	24,029
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	167	187
EGRESOS NETOS	1,357,553	2,133,745
UTILIDAD DE OPERACIÓN	309,276	234,126
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	89,883	(559,815)
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	399,160	(325,689)

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 31 de Enero de 2023 fueron aprobados los Estados Financieros del 31 de Diciembre de 2022, asimismo los presentes Estados Financieros al 31 de Marzo de 2023 serán aprobados en la Sesión del Consejo de Administración con fecha 3 de Mayo de 2023