

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

SIEFORE SURA BASICA 60-64, 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
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	22	10	Acreedores	280,387	512,150
Bancos monedas extranjeras	37,104	545,684	Provisiones para gastos	5,839	4,866
Divisas por recibir	115,837	5,905	Divisas por entregar	124,714	2,216
	152,963	551,598	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	4,565,371	4,108,941
INVERSIONES			TOTAL PASIVO	4,976,311	4,628,174
Inversión en valores de renta variable	12,968,032	8,513,988			
Plus (Minus) valia en valores de renta variable	(2,001,436)	1,080,913			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	24,054,478	20,324,490			
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	2,778,448	3,752,359			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	19,541,141	28,622,528			
Plus (Minus) valia en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(1,801,614)	(474,225)			
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	1,540,216	1,555,220			
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	(196,083)	397,906			
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	3,235,969	1,865,797			
Plus (Minus) valia instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	(77,700)	84,730			
Inversión en FIBRAS	1,923,182	1,950,244			
Plus (Minus) valia en Inversion en FIBRAS	(412,177)	(295,715)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	3,213	-			
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	4,716	33			
Inversión en valores extranjeros de deuda	132,426	145,426			
Plus (Minus) valia en Inversión en valores extranjeros de deuda	(4,062)	7,944			
Inversión en títulos Fiduciarios	3,945,900	3,082,966			
Plus (minus) valia en Títulos Fiduciarios	505,369	460,461			
Valores Prestados	-	277,581			
Plus (Minus) valia de valores prestados	-	6,598			
Inversión en Fondos Mutuos	2,017,054	2,063,743			
Plus (Minus) valia de Fondos Mutuos	(378,657)	232,527			
	67,778,414	73,655,515			
DEUDORES DIVERSOS			CAPITAL CONTABLE	2022	2021
Liquidadora	109,242	24,516	CAPITAL		
Dividendos o derechos por cobrar	9,225	4,910	CAPITAL CONTRIBUIDO	(70,912,088)	(68,087,895)
Intereses devengados sobre valores	827,205	783,724	Capital social pagado	5,572,632	5,793,753
Reportos	1,469,665	288,918	Prima en venta de acciones	(76,484,720)	(73,881,648)
Premios por cobrar por préstamo de valores	-	3	CAPITAL GANADO	140,590,755	136,974,806
Intereses devengados sobre valores prestados	-	7,219	Resultados de ejercicios anteriores	138,437,550	132,469,520
Reembolsos y otros intereses	3,272	104	Resultados del ejercicio	2,153,205	4,505,286
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	2,717,079	3,452,076	OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
	5,135,688	4,561,470	PLUS (MINUS) VALÍAS	(1,587,913)	5,253,499
			TOTAL CAPITAL CONTABLE	68,090,754	74,140,409
TOTAL ACTIVO	73,067,065	78,768,583	TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	73,067,065	78,768,583

CUENTAS DE ORDEN	2022	2021	CUENTAS DE ORDEN	2022	2021
Valores entregados en custodia	67,338,683	73,261,899	Capital social autorizado	27,500,100	27,500,100
Valores prestados	-	284,180	Acciones emitidas	27,500,100,000	27,500,100,000
Garantías recibidas por valores prestados	-	298,532	Acciones en circulación, posición propia	30,620,680	36,590,014
Colaterales recibidos por reportos	1,469,256	289,046	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	5,542,011,178	5,757,163,154
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	460,788	680,581			
Bancos divisas en moneda extranjera	1,884	26,538			
Dólares americanos	1,744	26,538			
Otras Divisas	140	-			
Divisas por recibir	5,765	287			
Dólares americanos	5,765	287			
Divisas por entregar	6,207	108			
Dólares americanos	6,207	108			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	2,322,723	2,562,489			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	104,784,960	148,148,049			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	1,190,627	6,612,368			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	1,699,463	2,875,517			
Contratos Adelantados sobre Euros	382,940	672,671			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	1,056,890	384,272			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	44,504,169	34,456,492			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	12,533,897	30,979,606			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	4,027,343	4,567,176			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	337,691	337,691			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	27,859,110	32,247,935			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	11,192,094	35,013,586			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	734	734			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	107,892,974	143,524,127			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	-	1,993,660			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	5,858,573	3,207,503			
Contratos Adelantados sobre Euros	277,719	189,600			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	1,225,725	149,357			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	-	313,821			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	24,126,509	28,515,334			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	12,528,894	36,550,279			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	2,683,983	2,683,983			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	342,826	518,978			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	46,571,484	36,678,641			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	13,939,571	32,385,281			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	337,691	337,691			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	-\$	1,587,913	\$	5,253,499
Un valor de los activos netos de:	\$	68,090,754	\$	74,140,409
El precio de la acción de:	\$	12.218778	\$	12.796612

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 60-64, 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)

	2022	2021
Ingresos por la venta de Valores	15,769,187	15,911,778
Intereses, dividendos, premios y derechos	3,312,422	2,719,450
Resultado cambiario / Otros productos	(26,208)	29,197
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	(614,478)	725,293
INGRESOS NETOS	18,440,923	19,385,718
Costo de ventas de valores	15,961,094	14,397,191
Gastos generales	10,789	16,735
Comisiones sobre saldos	308,309	457,312
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	7,527	9,195
EGRESOS NETOS	16,287,718	14,880,432
UTILIDAD DE OPERACIÓN	2,153,205	4,505,286
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(7,317,886)	(2,636,895)
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	(5,164,682)	1,868,391

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