

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 SEPTIEMBRE DE 2022 Y 2021

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2022	2021	PASIVO	2022	2021
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	35	10	Acreedores	669,621	564,764
Bancos monedas extranjeras	78,437	81,832	Provisiones para gastos	13,553	11,561
Divisas por recibir	657,025	-	Divisas por entregar	679,027	60,243
	735,496	81,842	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	4,969,230	2,319,431
INVERSIONES			TOTAL PASIVO	6,331,431	2,956,000
Inversión en valores de renta variable	26,545,827	19,465,679			
Plus (Minus) valia en valores de renta variable	(3,673,242)	1,876,024			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	40,777,617	35,023,673			
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	4,031,842	5,966,900			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	48,191,119	49,534,513			
Plus (Minus) valia en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(4,947,612)	(779,786)			
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	2,935,359	2,984,245			
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	(387,540)	689,347			
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	4,808,068	1,034,510			
Plus (Minus) valia instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	(52,722)	57,238			
Inversión en FIBRAS	4,298,365	4,174,237			
Plus (Minus) valia en Inversion en FIBRAS	(853,512)	(650,321)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	21,463	4,563			
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	9,807	68			
Inversión en valores extranjeros de deuda	777,413	320,649			
Plus (Minus) valia en Inversión en valores extranjeros de deuda	(55,529)	8,306			
Inversión en títulos Fiduciarios	13,242,181	10,230,401			
Plus (minus) valia en Títulos Fiduciarios	829,249	449,078			
Valores Prestados	-	782,738			
Plus (Minus) valia de valores prestados	-	8,293			
Inversión en Fondos Mutuos	5,375,084	5,429,266			
Plus (Minus) valia de Fondos Mutuos	(1,051,760)	580,523			
	140,821,477	137,190,146			
DEUDORES DIVERSOS			CAPITAL CONTABLE	2022	2021
Liquidadora	534	7,268	CAPITAL		
Dividendos o derechos por cobrar	13,655	12,722	CAPITAL CONTRIBUIDO	122,930,208	114,302,620
Intereses devengados sobre valores	1,587,690	1,252,847	Capital social pagado	129,258,877	121,840,470
Reportos	3,302,990	5,950,163	Prima en venta de acciones	(6,328,669)	(7,537,850)
Premios por cobrar por préstamo de valores	-	7			
Intereses devengados sobre valores prestados	-	18,708	CAPITAL GANADO	24,947,997	20,650,171
Reembolsos y otros intereses	111	-	Resultados de ejercicios anteriores	24,172,472	11,143,336
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	1,586,857	1,600,690	Resultados del ejercicio	775,525	9,506,836
	6,491,836	8,842,405	OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
			PLUS (MINUS) VALÍAS	(6,160,827)	8,205,602
			TOTAL CAPITAL CONTABLE	141,717,378	143,158,394
TOTAL ACTIVO	148,048,809	146,114,393	TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	148,048,809	146,114,393

CUENTAS DE ORDEN	2022	2021	CUENTAS DE ORDEN	2022	2021
Valores entregados en custodia	140,790,207	136,394,484	Capital social autorizado	35,000,100	35,000,100
Valores prestados	-	791,031	Acciones emitidas	35,000,100,000	35,000,100,000
Garantías recibidas por valores prestados	0	828,266	Acciones en circulación, posición propia	69,604,452	75,553,315
Colaterales recibidos por reportos	3,303,365	5,947,208	Acciones de Siefores, posición de terceros	1	1
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	84,870	331,978	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	12,856,283,286	12,108,493,678
Bancos divisas en moneda extranjera	4,010	3,980			
Dólares americanos	3,610	3,980			
Otras Divisas	400	-			
Divisas por recibir	32,700	-			
Dólares americanos	32,700	-			
Divisas por entregar	33,795	2,930			
Dólares americanos	33,795	2,930			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	6,101,595	7,303,563			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	110,725,058	104,493,358			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	24,001,349	21,059,787			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	13,118,654	8,465,088			
Contratos Adelantados sobre Euros	595,683	508,477			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	3,418,209	1,359,589			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	61,918	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	46,910,008	21,984,808			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	5,969,070	14,533,275			
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	11,014,317	15,214,317			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	4,408,252	19,386,394			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	1,527	1,527			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	96,021,771	92,894,319			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	2,626,794	5,176,229			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	17,757,224	13,200,089			
Contratos Adelantados sobre Euros	1,148,140	515,510			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	4,435,007	504,768			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	10,364,400	14,564,400			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	5,716,696	20,694,837			
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	45,376,192	21,076,963			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	6,447,954	15,012,159			
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:	-\$	6,160,827	\$	8,205,602
Un valor de los activos netos de:	\$	141,717,378	\$	143,158,394
El precio de la acción de:	\$	10.963841	\$	11.749659

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 SEPTIEMBRE DE 2022 Y 2021**

(Cifras en miles de pesos)

	2022	2021
Ingresos por la venta de Valores	27,495,039	34,132,763
Intereses, dividendos, premios y derechos	6,336,912	5,052,360
Resultado cambiario / Otros productos	166,944	45,168
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	(5,403,103)	1,979,402
INGRESOS NETOS	28,595,793	41,209,692
Costo de ventas de valores	27,149,470	30,804,446
Gastos generales	24,387	20,177
Comisiones sobre saldos	626,640	855,210
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	19,771	23,024
EGRESOS NETOS	27,820,268	31,702,857
UTILIDAD DE OPERACIÓN	775,525	9,506,836
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(15,221,719)	(4,955,722)
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	(14,446,194)	4,551,114

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