

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

SIEFORE SURA BASICA 75-79, 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	34	11	Acreedores	1,006,480	270,796
Bancos monedas extranjeras	57,322	70,792	Provisiones para gastos	13,695	11,959
Divisas por recibir	998,290	6,345	Divisas por entregar	998,289	74,082
	1,055,646	77,147	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	8,834,579	5,718,290
INVERSIONES			TOTAL PASIVO	10,853,043	6,075,127
Inversión en valores de renta variable	28,760,903	21,321,492			
Plus (Minus) valia en valores de renta variable	(3,990,464)	2,066,070			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	36,584,664	29,086,094			
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	2,826,928	4,611,390			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	42,927,649	45,858,001			
Plus (Minus) valia en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(4,687,518)	(780,497)			
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	2,637,427	2,623,699			
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	(390,563)	548,775			
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	5,285,756	2,120,770			
Plus (Minus) valia instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	(108,123)	80,519			
Inversión en FIBRAS	3,998,667	3,819,784			
Plus (Minus) valia en Inversion en FIBRAS	(773,544)	(606,632)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	4,166	-			
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	10,968	77			
Inversión en valores extranjeros de deuda	667,009	231,512			
Plus (Minus) valia en Inversión en valores extranjeros de deuda	(46,666)	6,619			
Inversión en títulos Fiduciarios	13,978,019	10,552,962			
Plus (minus) valia en Títulos Fiduciarios	907,025	349,221			
Valores Prestados	687,210	486,792			
Plus (Minus) valia de valores prestados	(89,556)	10,767			
Inversión en Fondos Mutuos	5,779,354	5,824,407			
Plus (Minus) valia de Fondos Mutuos	(1,129,906)	624,575			
	133,839,405	128,836,398			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	549	326,884			
Dividendos o derechos por cobrar	13,245	13,665			
Intereses devengados sobre valores	1,414,492	1,099,844			
Reportos	3,373,997	6,507,465			
Premios por cobrar por préstamo de valores	36	4			
Intereses devengados sobre valores prestados	11,910	12,053			
Reembolsos y otros intereses	6,098	858			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	4,764,060	4,586,011			
	9,584,386	12,546,783			
TOTAL ACTIVO	144,479,436	141,460,329			
			CAPITAL CONTABLE	2022	2021
			CAPITAL		
			CAPITAL CONTRIBUIDO	42,844,287	33,713,188
			Capital social pagado	53,284,909	49,872,286
			Prima en venta de acciones	(10,440,622)	(16,159,098)
			CAPITAL GANADO	98,264,493	94,761,206
			Resultados de ejercicios anteriores	98,266,176	85,500,172
			Resultados del ejercicio	(1,682)	9,261,034
			OTROS RESULTADOS INTEGRALES	(7,482,387)	6,910,808
			PLUS (MINUS) VALÍAS		
			TOTAL CAPITAL CONTABLE	133,626,393	135,385,202
			TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	144,479,436	141,460,329

CUENTAS DE ORDEN	2022	2021	CUENTAS DE ORDEN	2022	2021
Valores entregados en custodia	132,414,791	128,050,936	Capital social autorizado	126,259,200	126,259,200
Valores prestados	597,654	497,560	Acciones emitidas	25,000,019,801	25,000,019,801
Garantías recibidas por valores prestados	637,236	524,474	Acciones en circulación, posición propia	56,823,542	61,237,712
Colaterales recibidos por reportos	3,374,295	6,508,388	Acciones de Siefores, posición de terceros	2	2
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	595,131	802,911	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	10,493,883,173	9,813,750,684
Bancos divisas en moneda extranjera	2,962	3,443			
Dólares americanos	2,549	3,443			
Otras Divisas	413	-			
Divisas por recibir	49,685	309			
Dólares americanos	49,685	309			
Divisas por entregar	49,685	3,603			
Dólares americanos	49,685	3,603			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	6,664,193	8,040,092			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	165,373,551	204,994,475			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	25,892,909	22,597,670			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	11,633,919	8,960,018			
Contratos Adelantados sobre Euros	705,940	1,069,165			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	3,751,135	1,477,679			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	231,619	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	56,522,701	40,828,950			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	18,708,157	43,122,962			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	4,490,821	5,541,250			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	249,598	249,598			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	29,139,411	36,106,011			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	14,045,633	45,039,465			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	1,708	1,708			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	148,256,346	188,932,296			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	2,679,655	5,300,572			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	15,885,118	10,971,947			
Contratos Adelantados sobre Euros	1,373,478	561,194			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	4,862,214	582,361			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	-	328,803			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	25,004,634	31,971,234			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	15,985,991	47,213,725			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	3,184,497	3,184,497			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	236,239	458,911			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	58,757,594	43,657,321			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	20,037,328	44,452,132			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	249,598	249,598			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	-\$	7,482,387	\$	6,910,808
Un valor de los activos netos de:	\$	133,626,393	\$	135,385,202
El precio de la acción de:	\$	12.665160	\$	13.709910

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 75-79, 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	26,737,269	34,602,824
Intereses, dividendos, premios y derechos	5,903,264	4,767,985
Resultado cambiario / Otros productos	156,367	35,545
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	(6,020,680)	2,021,044
INGRESOS NETOS	26,776,220	41,427,398
Costo de ventas de valores	26,143,222	31,310,615
Gastos generales	20,579	26,042
Comisiones sobre saldos	592,860	805,239
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	21,241	24,468
EGRESOS NETOS	26,777,903	32,166,364
UTILIDAD DE OPERACIÓN	(1,682)	9,261,034
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(15,329,294)	(4,484,193)
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	(15,330,976)	4,776,841

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