

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 2023 Y 2022

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2023	2022	PASIVO	2023	2022
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	510	34	Acreedores	2,538,508	1,006,480
Bancos monedas extranjeras	1,408,587	57,322	Provisiones para gastos	14,207	13,695
Divisas por recibir	696	998,290	Divisas por entregar	-	998,289
	1,409,793	1,055,646	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	5,355,620	8,834,579
RESERVADOS			TOTAL PASIVO	7,908,335	10,853,043
Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en divisas	23,645	-			
	23,645	-	CAPITAL CONTABLE	2023	2022
INVERSIONES			CAPITAL		
Inversión en valores de renta variable	30,313,212	28,760,903	CAPITAL CONTRIBUIDO	48,940,375	42,844,287
Plus (Minus) valia en valores de renta variable	(1,604,161)	(3,990,464)	Capital social pagado	55,506,809	53,284,909
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	39,826,289	36,584,664	Prima en venta de acciones	(6,566,435)	(10,440,622)
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	2,675,067	2,826,928	CAPITAL GANADO	106,803,174	98,264,493
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	46,856,243	42,927,649	Resultados de ejercicios anteriores	101,325,490	98,266,176
Plus (Minus) valia en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(4,474,293)	(4,687,518)	Resultados del ejercicio	5,477,684	(1,682)
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	2,795,222	2,637,427	OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	(590,716)	(390,563)	PLUS (MINUS) VALÍAS	(5,463,811)	(7,482,387)
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	4,405,732	5,285,756			
Plus (Minus) valia instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	(243,790)	(108,123)	TOTAL CAPITAL CONTABLE	150,279,738	133,626,393
Inversión en FIBRAS	4,514,800	3,998,667			
Plus (Minus) valia en Inversion en FIBRAS	(235,421)	(773,544)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	5,228	4,166			
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	-	10,968			
Inversión en valores extranjeros de deuda	1,276,070	667,009			
Plus (Minus) valia en Inversión en valores extranjeros de deuda	(65,135)	(46,666)			
Inversión en títulos Fiduciarios	15,727,100	13,978,019			
Plus (minus) valia en Títulos Fiduciarios	178,048	907,025			
Valores Prestados	-	687,210			
Plus (Minus) valia de valores prestados	-	(89,556)			
Inversión en Fondos Mutuos	5,997,048	5,779,354			
Plus (Minus) valia de Fondos Mutuos	(1,103,409)	(1,129,906)			
	146,253,133	133,839,405			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	1,140,515	549			
Dividendos o derechos por cobrar	11,615	13,245			
Intereses devengados sobre valores	1,674,655	1,414,492			
Reportos	4,735,872	3,373,997			
Premios por cobrar por préstamo de valores	-	36			
Intereses devengados sobre valores prestados	-	11,910			
Reembolsos y otros intereses	158	6,098			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	2,938,687	4,764,060			
	10,501,502	9,584,386			
TOTAL ACTIVO	158,188,073	144,479,436	TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	158,188,073	144,479,436

CUENTAS DE ORDEN	2023	2022	CUENTAS DE ORDEN	2023	2022
Valores entregados en custodia	146,247,905	132,414,791	Capital social autorizado	126,259,200	126,259,200
Valores prestados	-	597,654	Acciones emitidas	25,000,019,801	25,000,019,801
Garantías recibidas por valores prestados	-	637,236	Acciones en circulación, posición propia	57,447,571	56,823,542
Colaterales recibidos por reportos	4,742,065	3,374,295	Acciones de Siefores, posición de terceros	2	2
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	96,636	595,131	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	10,933,207,617	10,493,883,173
Bancos divisas en moneda extranjera	78,307	2,962			
Dólares americanos	34,061	2,549			
Euros	44,202	-			
Otras Divisas	43	413			
Divisas por recibir	40	49,685			
Dólares americanos	40	49,685			
Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en moneda extranjera	1,357	-			
Dólares americanos	1,357	-			
Divisas por entregar	-	49,685			
Dólares americanos	-	49,685			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	5,903,744	6,664,193			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	119,097,879	165,373,551			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	24,896,528	25,892,909			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	13,735,256	11,633,919			
Contratos Adelantados sobre Euros	204,343	705,940			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	3,198,297	3,751,135			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	203,262	231,619			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	38,038,168	56,522,701			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	12,046,214	18,708,157			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	4,454,404	4,490,821			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	249,598	249,598			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	17,628,351	29,139,411			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	4,443,457	14,045,633			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	-	1,708			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	97,916,095	148,256,346			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	2,466,784	2,679,655			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	14,978,975	15,885,118			
Contratos Adelantados sobre Euros	-	1,373,478			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	3,619,708	4,862,214			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	13,586,134	25,004,634			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	5,647,034	15,985,991			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	3,184,497	3,184,497			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	236,239	236,239			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	40,571,743	58,757,594			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	13,375,384	20,037,328			
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:	-\$	5,463,811	-\$	7,482,387
Un valor de los activos netos de:	\$	150,279,738	\$	133,626,393
El precio de la acción de:	\$	13.673410	\$	12.665160

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 2023 Y 2022

(Cifras en miles de pesos)

	2023	2022
Ingresos por la venta de Valores	15,009,735	26,737,269
Intereses, dividendos, premios y derechos	6,262,986	5,903,264
Resultado cambiario / Otros productos	(457,475)	156,367
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	817,705	(6,020,680)
INGRESOS NETOS	21,632,952	26,776,220
Costo de ventas de valores	15,477,719	26,143,222
Gastos generales	16,652	20,579
Comisiones sobre saldos	642,148	592,860
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	18,748	21,241
EGRESOS NETOS	16,155,268	26,777,903
UTILIDAD DE OPERACIÓN	5,477,684	(1,682)
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(4,740,563)	(15,329,294)
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	737,120	(15,330,976)

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 9 de Agosto de 2023 fueron aprobados los Estados Financieros del 30 de Junio de 2023, asimismo los presentes Estados Financieros al 29 de Septiembre de 2023 serán aprobados en la Sesión del Consejo de Administración con fecha 24 de Noviembre de 2023