

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO
SIEFORE SURA BASICA 90-94, 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 JUNIO DE 2023 Y 2022

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2023	2022	PASIVO	2023	2022
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	10	4,130	Acreedores	360,345	405,757
Bancos monedas extranjeras	66,582	26,397	Provisiones para gastos	5,477	3,462
Divisas por recibir	261,600	56,575	Divisas por entregar	279,603	57,328
	328,191	87,102	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	872,029	1,700,792
INVERSIONES			TOTAL PASIVO	1,517,455	2,167,339
Inversión en valores de renta variable	12,927,530	11,544,939			
Plus (Minus) valia en valores de renta variable	(375,090)	(651,330)			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	14,699,111	10,431,941			
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	860,078	528,437			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	21,252,449	18,095,893			
Plus (Minus) valia en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(1,171,658)	(1,646,004)			
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	983,960	774,648			
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	(243,609)	(136,089)			
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	1,024,664	1,619,070			
Plus (Minus) valia instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	48,343	(838)			
Inversión en FIBRAS	1,663,032	1,166,711			
Plus (Minus) valia en Inversion en FIBRAS	(1,317)	(168,438)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	-	20,166			
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	-	1,190			
Inversión en valores extranjeros de deuda	173,476	174,376			
Plus (Minus) valia en Inversión en valores extranjeros de deuda	(6,759)	(8,392)			
Inversión en títulos Fiduciarios	5,009,574	4,108,720			
Plus (minus) valia en Títulos Fiduciarios	237,922	438,517			
Inversión en Fondos Mutuos	2,437,443	2,313,387			
Plus (Minus) valia de Fondos Mutuos	(465,815)	(309,957)			
	59,053,336	48,296,950			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	1,375	48,616			
Dividendos o derechos por cobrar	3,605	27			
Intereses devengados sobre valores	375,103	316,666			
Reportos	3,297,569	2,551,401			
Reembolsos y otros intereses	65	996			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	507,617	459,204			
	4,185,333	3,376,909			
TOTAL ACTIVO	63,566,861	51,760,960			
			CAPITAL CONTABLE	2023	2022
			CAPITAL		
			CAPITAL CONTRIBUIDO	53,133,730	44,826,965
			Capital social pagado	51,127,207	43,950,700
			Prima en venta de acciones	2,006,523	876,265
			CAPITAL GANADO	10,033,580	6,720,749
			Resultados de ejercicios anteriores	7,804,253	7,730,812
			Resultados del ejercicio	2,229,327	(1,010,063)
			OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
			PLUS (MINUS) VALÍAS	(1,117,904)	(1,954,094)
			TOTAL CAPITAL CONTABLE	62,049,406	49,593,621
			TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	63,566,861	51,760,960

CUENTAS DE ORDEN	2023	2022	CUENTAS DE ORDEN	2023	2022
Valores entregados en custodia	59,053,336	48,121,994	Capital social autorizado	35,000,100	35,000,100
Colaterales recibidos por reportos	3,299,553	2,552,522	Acciones emitidas	35,000,100,000	35,000,100,000
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	93,537	10,473	Acciones en circulación, posición propia	22,247,725	19,733,687
Bancos divisas en moneda extranjera	3,807	1,354	Acciones de Siefos, posición de terceros	1	1
Dólares americanos	2,858	1,154	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	4,112,079,785	3,534,276,002
Euros	919	-			
Otras Divisas	30	201			
Divisas por recibir	15,284	2,810			
Dólares americanos	15,284	2,810			
Divisas por entregar	16,336	2,847			
Dólares americanos	16,336	2,847			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	1,781,859	2,031,217			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	29,950,008	37,015,672			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	11,909,165	12,499,195			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	5,523,896	3,850,636			
Contratos Adelantados sobre Euros	1,820,539	1,110,028			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	703,133	892,458			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	123,765	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	5,946,205	11,282,356			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	1,807,677	1,042,870			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	163,629	336,393			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	48,941	48,941			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	1,781,575	5,612,125			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	121,483	340,176			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	-	494			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	16,113,939	24,630,480			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	289,426	-			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	4,346,854	3,886,951			
Contratos Adelantados sobre Euros	598,339	1,072,791			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	756,045	814,471			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	1,172,000	5,002,550			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	466,506	840,874			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	702,414	702,414			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	62,888	62,888			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	5,741,934	11,034,814			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	1,928,593	1,163,786			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	48,941	48,941			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	-\$	1,117,904	-\$	1,954,094
Un valor de los activos netos de:	\$	62,049,406	\$	49,593,621
El precio de la acción de:	\$	15.008343	\$	13.954273

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 90-94, 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 JUNIO DE 2023 Y 2022

(Cifras en miles de pesos)

	2023	2022
Ingresos por la venta de Valores	5,277,627	7,513,761
Intereses, dividendos, premios y derechos	1,645,380	1,380,869
Resultado cambiario / Otros productos	(93,853)	(13,059)
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	1,181,635	(2,546,273)
INGRESOS NETOS	8,010,790	6,335,297
Costo de ventas de valores	5,601,556	7,196,332
Gastos generales	6,717	6,237
Comisiones sobre saldos	168,197	137,185
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	4,992	5,607
EGRESOS NETOS	5,781,463	7,345,361
UTILIDAD DE OPERACIÓN	2,229,327	(1,010,063)
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	246,475	(3,690,728)
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	2,475,802	(4,700,792)

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 3 de Mayo de 2023 fueron aprobados los Estados Financieros del 31 de Marzo de 2023, asimismo los presentes Estados Financieros al 30 de Junio de 2023 serán aprobados en la Sesión del Consejo de Administración con fecha 9 de Agosto de 2023