

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 31 DE MARZO DE 2024 Y 2023

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2024	2023	PASIVO	2024	2023
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	79	19	Acreedores	3,185	836,963
Bancos monedas extranjeras	43,877	351,409	Provisiones para gastos	7,349	5,542
Divisas por recibir	-	180,063	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	3,126,156	3,030,467
	43,955	531,491	TOTAL PASIVO	3,136,691	3,872,971
INVERSIONES			CONTABLE	2024	2023
Inversión en valores de renta variable	7,891,789	10,345,863	CAPITAL		
Plus (Minus) valia en valores de renta variable	98,330	(751,008)	CAPITAL CONTRIBUIDO	(85,083,341)	(74,958,470)
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	19,066,416	21,693,775	Capital social pagado	4,514,313	5,259,766
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	2,498,414	2,977,047	Prima en venta de acciones	(89,597,654)	(80,218,236)
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	21,288,342	23,086,964	CAPITAL GANADO	147,879,077	143,894,029
Plus (Minus) valia en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(1,064,585)	(1,044,193)	Resultados de ejercicios anteriores	147,068,377	142,326,709
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	1,373,154	1,647,012	Resultados del ejercicio	810,700	1,567,321
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	(234,979)	(201,844)	OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
Inversión en Depósito Banxico	8,530	10,977	PLUS (MINUS) VALÍAS	1,228,107	1,180,550
Plus (Minus) valia en Depósito Banxico	143	184	TOTAL CAPITAL CONTABLE	64,023,842	70,116,110
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	1,804,979	1,812,147			
Plus (Minus) valia instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	78,080	103,297			
Inversión en FIBRAS	1,794,251	2,003,124			
Plus (Minus) valia en Inversion en FIBRAS	24,561	(173,723)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	-	1,418			
Inversión en valores extranjeros de deuda	876,946	680,426			
Plus (Minus) valia en Inversión en valores extranjeros de deuda	15,678	948			
Inversión en títulos Fiduciarios	3,865,990	3,561,598			
Plus (minus) valia en Títulos Fiduciarios	57,121	577,113			
Valores Prestados	-	106,887			
Plus (Minus) valia de valores prestados	-	(7,541)			
Inversión en Fondos Mutuos	1,995,343	2,010,351			
Plus (Minus) valia de Fondos Mutuos	(244,656)	(299,730)			
	61,193,847	68,141,093			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	28	848,296			
Dividendos o derechos por cobrar	987	29			
Intereses devengados sobre valores	830,226	853,602			
Reportos	2,632,102	1,105,022			
Premios por cobrar por préstamo de valores	-	6			
Intereses devengados sobre valores prestados	-	3,222			
Reembolsos y otros intereses	57	3,444			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	2,459,331	2,502,876			
	5,922,731	5,316,497			
TOTAL ACTIVO	67,160,533	73,989,081	TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	67,160,533	73,989,081

CUENTAS DE ORDEN	2024	2023	CUENTAS DE ORDEN	2024	2023
Valores entregados en custodia	61,193,847	67,762,726	Capital social autorizado	27,500,100	27,500,100
Valores prestados	-	99,346	Acciones emitidas	27,500,100,000	27,500,100,000
Garantías recibidas por valores prestados	-	106,854	Acciones en circulación, posición propia	25,964,174	30,620,679
Colaterales recibidos por reportos	2,637,404	1,105,415	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	4,488,348,941	5,229,145,498
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	315,227	542,352			
Bancos divisas en moneda extranjera	2,566	18,814			
Dólares americanos	1,539	10,759			
Euros	1,001	8,035			
Otras Divisas	26	20			
Divisas por recibir	-	9,992			
Dólares americanos	-	9,992			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	1,875,695	1,877,050			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	58,388,940	77,122,410			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	965,492	1,456,902			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	5,844,896	1,843,403			
Contratos Adelantados sobre Euros	740,518	780,923			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	894,034	572,292			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	20,623,696	29,017,876			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	7,135,122	10,539,441			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	3,740,050	3,730,833			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	337,691	337,691			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	13,738,205	20,012,996			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	4,369,236	8,830,052			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	58,676,348	80,338,200			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	-	130,296			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	7,868,600	7,012,663			
Contratos Adelantados sobre Euros	409,386	27,907			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	444,625	655,144			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	10,195,668	16,470,459			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	4,422,810	9,719,990			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	2,459,757	2,459,757			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	227,849	342,826			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	23,769,165	31,236,352			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	8,540,796	11,945,116			
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:	\$	1,228,107	\$	1,180,550
Un valor de los activos netos de:	\$	64,023,842	\$	70,116,110
El precio de la acción de:	\$	14.182411	\$	13.330651

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 31 DE MARZO DE 2024 Y 2023

(Cifras en miles de pesos)

	2024	2023
Ingresos por la venta de Valores	4,252,946	4,797,379
Intereses, dividendos, premios y derechos	913,900	1,038,145
Resultado cambiario / Otros productos	1,811	(65,122)
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	(87,112)	712,528
INGRESOS NETOS	5,081,545	6,482,929
Costo de ventas de valores	4,175,147	4,809,330
Gastos generales	2,276	3,607
Comisiones sobre saldos	91,293	100,351
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	2,129	2,321
EGRESOS NETOS	4,270,844	4,915,608
UTILIDAD DE OPERACIÓN	810,700	1,567,321
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(428,389)	307,633
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	382,312	1,874,954

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 27 de febrero de 2024 fueron aprobados los Estados Financieros del 29 de Diciembre de 2023, asimismo los presentes Estados Financieros al 29 de Marzo de 2024 serán aprobados en la Sesión del Consejo de Administración con fecha 22 de mayo 2024