

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 30 DE SEPTIEMBRE DE 2023 Y 2022

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2023	2022	PASIVO	2023	2022
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	148	22	Acreedores	176,676	280,387
Bancos monedas extranjeras	196,604	37,104	Provisiones para gastos	5,455	5,839
Divisas por recibir	336,787	115,837	Divisas por entregar	-	124,714
	533,539	152,963	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	3,363,505	4,565,371
INVERSIONES			TOTAL PASIVO	3,545,636	4,976,311
Inversión en valores de renta variable	9,255,680	12,968,032			
Plus (Minus) valia en valores de renta variable	(1,008,868)	(2,001,436)			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	20,030,255	24,054,478			
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	1,795,154	2,778,448			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	22,004,828	19,541,141			
Plus (Minus) valia en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(1,835,338)	(1,801,614)			
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	1,641,331	1,540,216			
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	(304,180)	(196,083)			
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	2,456,574	3,235,969			
Plus (Minus) valia instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	(18,230)	(77,700)			
Inversión en FIBRAS	2,020,847	1,923,182			
Plus (Minus) valia en Inversion en FIBRAS	(130,652)	(412,177)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	-	3,213			
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	-	4,716			
Inversión en valores extranjeros de deuda	958,200	132,426			
Plus (Minus) valia en Inversión en valores extranjeros de deuda	(16,743)	(4,062)			
Inversión en títulos Fiduciarios	3,869,500	3,945,900			
Plus (minus) valia en Títulos Fiduciarios	137,930	505,369			
Inversión en Fondos Mutuos	2,017,999	2,017,054			
Plus (Minus) valia de Fondos Mutuos	(358,403)	(378,657)			
	62,515,884	67,778,414			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	153,123	109,242			
Dividendos o derechos por cobrar	15,646	9,225			
Intereses devengados sobre valores	882,508	827,205			
Reportos	1,249,312	1,469,665			
Reembolsos y otros intereses	46	3,272			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	2,308,216	2,717,079			
	4,608,852	5,135,688			
TOTAL ACTIVO	67,658,275	73,067,065			
			CAPITAL CONTABLE	2023	2022
			CAPITAL		
			CAPITAL CONTRIBUIDO	(79,950,272)	(70,912,088)
			Capital social pagado	4,886,000	5,572,632
			Prima en venta de acciones	(84,836,272)	(76,484,720)
			CAPITAL GANADO	145,802,242	140,590,755
			Resultados de ejercicios anteriores	142,326,709	138,437,550
			Resultados del ejercicio	3,475,533	2,153,205
			OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
			PLUS (MINUS) VALÍAS	(1,739,330)	(1,587,913)
			TOTAL CAPITAL CONTABLE	64,112,640	68,090,754
			TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	67,658,275	73,067,065

CUENTAS DE ORDEN	2023	2022	CUENTAS DE ORDEN	2023	2022
Valores entregados en custodia	62,515,884	67,338,683	Capital social autorizado	27,500,100	27,500,100
Colaterales recibidos por reportos	1,251,248	1,469,256	Acciones emitidas	27,500,100,000	27,500,100,000
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	223,374	460,788	Acciones en circulación, posición propia	25,964,174	30,620,680
Bancos divisas en moneda extranjera	10,746	1,884	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	4,860,035,754	5,542,011,178
Dólares americanos	1,304	1,744			
Euros	9,422	-			
Otras Divisas	20	140			
Divisas por recibir	19,325	5,765			
Dólares americanos	19,325	5,765			
Divisas por entregar	-	6,207			
Dólares americanos	-	6,207			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	1,875,695	2,322,723			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	62,581,356	104,784,960			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	1,591,218	1,190,627			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	2,701,333	1,699,463			
Contratos Adelantados sobre Euros	190,600	382,940			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	721,666	1,056,890			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	18,624	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	23,646,569	44,504,169			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	7,509,763	12,533,897			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	3,730,833	4,027,343			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	337,691	337,691			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	16,254,996	27,859,110			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	5,878,064	11,192,094			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	-	734			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	65,242,189	107,892,974			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	421,969	-			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	6,662,870	5,858,573			
Contratos Adelantados sobre Euros	-	277,719			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	756,132	1,225,725			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	12,712,459	24,126,509			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	6,768,002	12,528,894			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	2,459,757	2,683,983			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	342,826	342,826			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	25,865,045	46,571,484			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	8,915,437	13,939,571			
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:	-\$	1,739,330	-\$	1,587,913
Un valor de los activos netos de:	\$	64,112,640	\$	68,090,754
El precio de la acción de:	\$	13.121703	\$	12.218778

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 30 DE SEPTIEMBRE DE 2023 Y 2022**

(Cifras en miles de pesos)

	2023	2022
Ingresos por la venta de Valores	10,899,139	15,769,187
Intereses, dividendos, premios y derechos	3,125,463	3,312,422
Resultado cambiario / Otros productos	(93,968)	(26,208)
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	485,482	(614,478)
INGRESOS NETOS	14,416,115	18,440,923
Costo de ventas de valores	10,632,076	15,961,094
Gastos generales	9,124	10,789
Comisiones sobre saldos	292,785	308,309
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	6,596	7,527
EGRESOS NETOS	10,940,581	16,287,718
UTILIDAD DE OPERACIÓN	3,475,533	2,153,205
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(2,612,247)	(7,317,886)
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	863,286	(5,164,682)

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