

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

**SIEFORE SURA BASICA 70-74, 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	148	28	Acreedores	44,263	1,703,575
Bancos monedas extranjeras	86,907	1,280,198	Provisiones para gastos	20,226	13,424
	87,055	1,280,226	Divisas por entregar	-	269,164
INVERSIONES			Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	2,420,774	1,881,159
Inversión en valores de renta variable	26,870,587	26,729,596	TOTAL PASIVO	2,485,262	3,867,322
Plus (Minus) valia en valores de renta variable	1,282,565	(262,110)			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	48,351,213	43,115,093			
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	5,075,142	5,695,130			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	53,601,696	49,283,845			
Plus (Minus) valia en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(2,828,406)	(3,055,422)			
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	2,657,280	3,075,034			
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	(495,228)	(410,309)	CAPITAL CONTABLE	2024	2023
Inversión en Depósito Banxico	245,940	176,176	CAPITAL		
Plus (Minus) valia en Depósito Banxico	4,110	2,951	CAPITAL CONTRIBUIDO	131,189,093	125,162,762
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	2,809,509	2,527,521	Capital social pagado	136,020,278	131,134,629
Plus (Minus) valia instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	83,357	57,688	Prima en venta de acciones	(4,831,185)	(5,971,867)
Inversión en FIBRAS	4,926,086	4,551,491	CAPITAL GANADO	41,374,103	31,414,438
Plus (Minus) valia en Inversion en FIBRAS	22,314	(341,316)	Resultados de ejercicios anteriores	38,669,442	28,561,501
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	11,967	80,911	Resultados del ejercicio	2,704,661	2,852,937
Inversión en valores extranjeros de deuda	2,808,601	1,453,413	OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
Plus (Minus) valia en Inversión en valores extranjeros de deuda	(10,195)	(20,260)	PLUS (MINUS) VALÍAS	2,521,752	1,730,966
Inversión en títulos Fiduciarios	15,460,753	13,313,959	TOTAL CAPITAL CONTABLE	175,084,949	158,308,165
Plus (minus) valia en Títulos Fiduciarios	102,824	957,929			
Valores Prestados	-	633,934			
Plus (Minus) valia de valores prestados	-	(48,580)			
Inversión en Fondos Mutuos	5,692,547	5,385,637			
Plus (Minus) valia de Fondos Mutuos	(714,730)	(844,735)			
	165,957,930	152,057,577			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	124	933,723			
Dividendos o derechos por cobrar	2,001	72			
Intereses devengados sobre valores	2,012,854	1,648,381			
Reportos	7,961,960	5,082,360			
Premios por cobrar por préstamo de valores	-	28			
Intereses devengados sobre valores prestados	-	11,924			
Reembolsos y otros intereses	187	120			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	1,548,100	1,161,077			
	11,525,226	8,837,685			
TOTAL ACTIVO	177,570,211	162,175,488	TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	177,570,211	162,175,488

CUENTAS DE ORDEN	2024	2023	CUENTAS DE ORDEN	2024	2023
Valores entregados en custodia	165,945,963	151,391,311	Capital social autorizado	35,000,100	35,000,100
Valores prestados	-	585,355	Acciones emitidas	35,000,100,000	35,000,100,000
Garantías recibidas por valores prestados	-	619,597	Acciones en circulación, posición propia	70,357,596	70,550,704
Colaterales recibidos por reportos	7,977,965	5,084,240	Acciones de Siefores, posición de terceros	1	1
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	306,755	190,514	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	13,531,670,194	13,042,912,164
Bancos divisas en moneda extranjera	5,155	67,940			
Dólares americanos	4,083	31,683			
Euros	1,017	36,215			
Otras Divisas	55	42			
Divisas por entregar	-	14,937			
Dólares americanos	-	14,937			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	5,356,215	5,572,836			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	93,846,595	78,963,062			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	23,891,604	22,867,018			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	24,706,353	7,373,956			
Contratos Adelantados sobre Euros	2,675,562	2,932,589			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	3,796,009	1,766,451			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	24,275,767	32,707,485			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	9,581,577	5,427,273			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	2,861,856	1,135,530			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	90,540	90,540			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	1,156,817	3,035,817			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	810,509	1,626,404			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	63,232,247	60,727,572			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	172,483	1,822,459			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	19,795,655	11,661,841			
Contratos Adelantados sobre Euros	1,609,107	125,377			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	2,460,987	2,660,897			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	506,900	2,385,900			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	1,092,115	2,131,983			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	1,792,702	1,792,702			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	218,575	266,123			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	25,432,723	31,883,592			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	10,060,460	5,906,157			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	90,540	90,540			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$	2,521,752	\$	1,730,966
Un valor de los activos netos de:	\$	175,084,949	\$	158,308,165
El precio de la acción de:	\$	12.871974	\$	12.072186

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 70-74, 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	6,993,323	6,096,417
Intereses, dividendos, premios y derechos	2,319,721	2,079,139
Resultado cambiario / Otros productos	4,758	(312,454)
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	798,001	1,688,799
INGRESOS NETOS	10,115,802	9,551,902
Costo de ventas de valores	7,156,758	6,461,473
Gastos generales	7,161	9,561
Comisiones sobre saldos	241,320	221,776
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	5,902	6,155
EGRESOS NETOS	7,411,141	6,698,966
UTILIDAD DE OPERACIÓN	2,704,661	2,852,937
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(1,023,493)	1,481,415
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	1,681,168	4,334,351

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