

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO
SIEFORE SURA BASICA 85-89, 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 2023 Y 2022

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2023	2022	PASIVO	2023	2022
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	16	11	Acreedores	1,155,022	114,938
Bancos monedas extranjeras	847,591	398,613	Provisiones para gastos	9,727	7,057
Divisas por recibir	686	280,727	Divisas por entregar	392,319	533,337
	848,294	679,350	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	3,357,808	4,437,989
INVERSIONES			TOTAL PASIVO	4,914,876	5,093,320
Inversión en valores de renta variable	21,565,677	18,358,999			
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	(61,420)	1,121,228			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	23,643,304	18,981,961			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	1,802,620	1,315,039			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	35,099,621	33,741,320			
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(2,256,443)	(1,895,699)			
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	1,647,477	1,488,082			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	(333,566)	5,390			
Inversión en Depósito Banxico	10,425	11,975			
Plus (Minus) valía en Depósito Banxico	175	229			
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	1,421,687	1,586,151			
Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	23,560	(1,577)			
Inversión en FIBRAS	2,833,987	1,995,185			
Plus (Minus) valía en Inversión en FIBRAS	(60,119)	(259,248)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	28,087	18,466			
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	-	5,380			
Inversión en valores extranjeros de deuda	533,805	522,405			
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	(18,164)	262			
Inversión en títulos Fiduciarios	8,845,293	7,567,735			
Plus (minus) valía en Títulos Fiduciarios	765,371	592,915			
Valores Prestados	-	282,125			
Plus (Minus) valía de valores prestados	-	(17,587)			
Inversión en Fondos Mutuos	4,399,295	4,400,564			
Plus (Minus) valía de Fondos Mutuos	(718,992)	(99,941)			
	99,171,679	89,721,358			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	649,482	476,258			
Dividendos o derechos por cobrar	40	40			
Intereses devengados sobre valores	955,564	750,318			
Reportos	4,278,749	2,963,674			
Premios por cobrar por préstamo de valores	-	5			
Intereses devengados sobre valores prestados	-	2,562			
Reembolsos y otros intereses	108	123			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	3,004,341	3,456,873			
	8,888,285	7,649,853			
TOTAL ACTIVO	108,908,257	98,050,561			
			CAPITAL CONTABLE	2023	2022
			CAPITAL		
			CAPITAL CONTRIBUIDO	28,147,278	16,865,709
			Capital social pagado	35,204,566	31,210,123
			Prima en venta de acciones	(7,057,288)	(14,344,414)
			CAPITAL GANADO	76,703,083	75,330,520
			Resultados de ejercicios anteriores	74,865,510	74,614,971
			Resultados del ejercicio	1,837,573	715,549
			OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
			PLUS (MINUS) VALÍAS	(856,979)	761,012
			TOTAL CAPITAL CONTABLE	103,993,381	92,957,241
			TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	108,908,257	98,050,561

CUENTAS DE ORDEN	2023	2022	CUENTAS DE ORDEN	2023	2022
Valores entregados en custodia	99,143,592	89,432,974	Capital social autorizado	126,259,200	126,259,200
Valores prestados	-	264,538	Acciones emitidas	25,000,019,801	25,000,019,801
Garantías recibidas por valores prestados	0	277,358	Acciones en circulación, posición propia	37,525,884	34,486,475
Colaterales recibidos por reportos	4,279,518	2,964,299	Acciones de Siefores, posición de terceros	2	2
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	312,102	521,156	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	6,933,172,883	6,145,290,503
Bancos divisas en moneda extranjera	45,252	20,080			
Dólares americanos	24,392	19,773			
Euros	20,822	-			
Otras Divisas	37	307			
Divisas por recibir	38	14,099			
Dólares americanos	38	14,099			
Divisas por entregar	21,771	26,786			
Dólares americanos	21,771	26,786			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	3,567,250	4,185,927			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	97,327,755	149,274,788			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	22,258,146	26,229,971			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	6,482,176	10,171,512			
Contratos Adelantados sobre Euros	1,772,981	1,075,552			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	1,582,021	1,012,161			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	-	11,713			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	27,829,622	35,869,757			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	9,436,991	21,918,155			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	2,280,760	3,373,711			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	119,905	119,905			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	16,585,929	27,456,379			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	8,979,225	22,034,908			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	-	1,065			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	79,445,765	121,918,168			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	3,226,484	3,697,456			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	9,907,030	6,111,589			
Contratos Adelantados sobre Euros	99,291	1,306,767			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	942,218	133,338			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	15,606,153	26,476,603			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	8,757,565	22,678,608			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	2,179,600	2,179,600			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	123,685	266,202			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	27,863,551	35,846,653			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	10,620,284	23,101,447			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	119,905	119,905			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	-\$	856,979	\$	761,012
Un valor de los activos netos de:	\$	103,993,381	\$	92,957,241
El precio de la acción de:	\$	14.918645	\$	15.042168

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 85-89, 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 2023 Y 2022

(Cifras en miles de pesos)

	2023	2022
Ingresos por la venta de Valores	5,528,100	7,183,971
Intereses, dividendos, premios y derechos	1,271,196	1,289,330
Resultado cambiario / Otros productos	(142,323)	(53,133)
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	1,260,794	(885,010)
INGRESOS NETOS	7,917,766	7,535,160
Costo de ventas de valores	5,924,856	6,683,689
Gastos generales	6,084	5,729
Comisiones sobre saldos	144,275	124,565
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	4,979	5,628
EGRESOS NETOS	6,080,194	6,819,611
UTILIDAD DE OPERACIÓN	1,837,573	715,549
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	1,182,212	(2,976,456)
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	3,019,784	(2,260,907)

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 31 de Enero de 2023 fueron aprobados los Estados Financieros del 31 de Diciembre de 2022, asimismo los presentes Estados Financieros al 31 de Marzo de 2023 serán aprobados en la Sesión del Consejo de Administración con fecha 3 de Mayo de 2023