

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 30 DE SEPTIEMBRE DE 2022 Y 2021

(Cifras en miles de pesos)

| ACTIVO | 2022 | 2021 | PASIVO | 2022 | 2021 |
|---|-------------------|-------------------|---|-------------------|-------------------|
| DISPONIBLE | | | OBLIGACIONES | | |
| Bancos moneda nacional | 18 | 10 | Acreedores | 1,526,527 | 51,094 |
| Bancos monedas extranjeras | 59,536 | 62,180 | Provisiones para gastos | 9,744 | 8,588 |
| Divisas por recibir | 832,837 | 5,576 | Divisas por entregar | 855,080 | 111,276 |
| | 892,391 | 67,765 | Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC) | 7,043,700 | 4,153,416 |
| INVERSIONES | | | TOTAL PASIVO | 9,435,051 | 4,324,374 |
| Inversión en valores de renta variable | 23,161,014 | 15,643,133 | | | |
| Plus (Minus) valia en valores de renta variable | (3,147,601) | 1,373,198 | | | |
| Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís | 20,262,000 | 15,472,901 | | | |
| Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís | 634,922 | 1,650,865 | | | |
| Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos | 32,032,397 | 32,820,135 | | | |
| Plus (Minus) valia en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos | (3,403,927) | (548,993) | | | |
| Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso | 1,485,950 | 1,401,894 | | | |
| Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso | (326,948) | 195,490 | | | |
| Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas | 3,938,839 | 726,216 | | | |
| Plus (Minus) valia instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas | (65,771) | 25,175 | | | |
| Inversión en FIBRAS | 2,207,593 | 1,951,583 | | | |
| Plus (Minus) valia en Inversion en FIBRAS | (326,373) | (244,713) | | | |
| Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados | 9,600 | 967 | | | |
| Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC) | 6,837 | 48 | | | |
| Inversión en valores extranjeros de deuda | 534,805 | 64,945 | | | |
| Plus (Minus) valia en Inversión en valores extranjeros de deuda | (36,358) | 2,175 | | | |
| Inversión en títulos Fiduciarios | 7,946,193 | 6,144,549 | | | |
| Plus (minus) valia en Títulos Fiduciarios | 803,530 | 252,735 | | | |
| Valores Prestados | 260,417 | - | | | |
| Plus (Minus) valia de valores prestados | (20,590) | - | | | |
| Inversión en Fondos Mutuos | 4,400,564 | 4,398,098 | | | |
| Plus (Minus) valia de Fondos Mutuos | (897,617) | 413,364 | | | |
| | 89,459,478 | 81,743,764 | | | |
| DEUDORES DIVERSOS | | | CAPITAL CONTABLE | 2022 | 2021 |
| Liquidadora | 507 | 59,570 | CAPITAL | | |
| Dividendos o derechos por cobrar | 10,586 | 10,239 | CAPITAL CONTRIBUIDO | 23,623,632 | 11,342,330 |
| Intereses devengados sobre valores | 871,462 | 622,964 | Capital social pagado | 33,644,162 | 29,359,709 |
| Reportos | 3,431,086 | 4,307,088 | Prima en venta de acciones | (10,020,530) | (18,017,379) |
| Premios por cobrar por préstamo de valores | 42 | - | CAPITAL GANADO | 72,330,275 | 72,094,147 |
| Intereses devengados sobre valores prestados | 1,389 | - | Resultados de ejercicios anteriores | 74,614,971 | 65,663,719 |
| Reembolsos y otros intereses | 100 | - | Resultados del ejercicio | (2,284,697) | 6,430,428 |
| Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC) | 3,935,182 | 4,068,756 | OTROS RESULTADOS INTEGRALES | | |
| | 8,250,355 | 9,068,618 | PLUS (MINUS) VALÍAS | (6,786,734) | 3,119,296 |
| | | | TOTAL CAPITAL CONTABLE | 89,167,173 | 86,555,773 |
| TOTAL ACTIVO | 98,602,224 | 90,880,147 | TOTAL PASIVO MAS CAPITAL | 98,602,224 | 90,880,147 |

| CUENTAS DE ORDEN | 2022 | 2021 | CUENTAS DE ORDEN | 2022 | 2021 |
|--|--------------------|--------------------|---|----------------|----------------|
| Valores entregados en custodia | 89,203,213 | 81,742,749 | Capital social autorizado | 126,259,200 | 126,259,200 |
| Valores prestados | 239,827 | - | Acciones emitidas | 25,000,019,801 | 25,000,019,801 |
| Garantías recibidas por valores prestados | 246,631 | - | Acciones en circulación, posición propia | 35,876,794 | 36,011,547 |
| Colaterales recibidos por reportos | 3,431,351 | 4,304,666 | Acciones de Siefores, posición de terceros | 2 | 2 |
| Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC) | 286,239 | 786,834 | Acciones en circulación propiedad de los trabajadores | 6,625,853,358 | 5,777,373,135 |
| Bancos divisas en moneda extranjera | 3,037 | 3,024 | | | |
| Dólares americanos | 2,754 | 3,024 | | | |
| Otras Divisas | 283 | - | | | |
| Divisas por recibir | 41,450 | 271 | | | |
| Dólares americanos | 41,450 | 271 | | | |
| Divisas por entregar | 42,557 | 5,412 | | | |
| Dólares americanos | 42,557 | 5,412 | | | |
| Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios | 3,895,453 | 4,797,845 | | | |
| Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga | 122,315,732 | 160,594,581 | | | |
| Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera | 22,769,329 | 19,650,317 | | | |
| Contratos Adelantados sobre Dólar Americano | 9,700,553 | 6,538,705 | | | |
| Contratos Adelantados sobre Euros | 499,359 | 930,043 | | | |
| Contratos Adelantados sobre Otras Divisas | 2,068,362 | 1,667,585 | | | |
| Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional | - | 240,097 | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos | 38,239,016 | 32,782,601 | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano | 12,178,281 | 33,755,121 | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS | 2,663,307 | 3,544,639 | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros | 119,905 | 119,905 | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos | 21,254,179 | 27,403,379 | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano | 12,822,376 | 33,961,126 | | | |
| Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional | 1,065 | 1,065 | | | |
| Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta | 102,989,137 | 143,209,861 | | | |
| Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera | 1,489,955 | 3,562,935 | | | |
| Contratos Adelantados sobre Dólar Americano | 11,414,246 | 6,820,483 | | | |
| Contratos Adelantados sobre Euros | 871,428 | 415,804 | | | |
| Contratos Adelantados sobre Otras Divisas | 2,031,872 | 516,198 | | | |
| Contratos Futuros sobre Dólar Americano | - | 435,300 | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos | 20,274,403 | 26,423,603 | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano | 13,285,766 | 34,649,265 | | | |
| 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 | 37,836,705 | 32,882,153 | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano | 13,361,573 | 34,938,413 | | | |
| 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: | -\$ | 6,786,734 | \$ | 3,119,296 |
| Un valor de los activos netos de: | \$ | 89,167,173 | \$ | 86,555,773 |
| El precio de la acción de: | \$ | 13.384987 | \$ | 14.889050 |

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 30 DE SEPTIEMBRE DE 2022 Y 2021**

(Cifras en miles de pesos)

| | 2022 | 2021 |
|--|---------------------|-------------------|
| Ingresos por la venta de Valores | 17,984,920 | 26,782,146 |
| Intereses, dividendos, premios y derechos | 3,743,503 | 2,831,168 |
| Resultado cambiario / Otros productos | (32,403) | 26,104 |
| Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados | (5,959,767) | 1,674,558 |
| INGRESOS NETOS | 15,736,253 | 31,313,976 |
| Costo de ventas de valores | 17,596,710 | 24,347,326 |
| Gastos generales | 17,976 | 18,985 |
| Comisiones sobre saldos | 390,327 | 499,308 |
| Comisiones por gestión de Fondos Mutuos | 15,936 | 17,928 |
| EGRESOS NETOS | 18,020,950 | 24,883,548 |
| UTILIDAD DE OPERACIÓN | (2,284,697) | 6,430,428 |
| OTROS RESULTADOS INTEGRALES | | |
| PLUS (MINUS) VALÍAS | (10,524,202) | (2,991,695) |
| UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO | (12,808,899) | 3,438,733 |

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 11 de julio de 2022 fueron aprobados los Estados Financieros del 30 de Junio de 2022, asimismo los presentes Estados Financieros al 30 de Septiembre de 2022 serán aprobados en la Sesión del Consejo de Administración con fecha 11 de octubre de 2022