

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO
SIEFORE SURA BASICA 90-94, 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	13	11	Acreedores	811,905	66,366
Bancos monedas extranjeras	586,233	195,942	Provisiones para gastos	5,342	3,704
Divisas por recibir	-	138,669	Divisas por entregar	318,233	256,693
	586,245	334,622	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	856,594	1,314,140
INVERSIONES			TOTAL PASIVO	1,992,073	1,640,904
Inversión en valores de renta variable	12,482,464	10,142,213			
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	(91,603)	572,650			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	13,120,765	10,989,780			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	901,457	588,673			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	20,438,641	18,317,977			
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(1,358,290)	(1,106,290)			
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	985,125	775,727			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	(185,582)	(3,052)			
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	1,048,322	845,831			
Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	57,111	12,187			
Inversión en FIBRAS	1,564,622	1,077,466			
Plus (Minus) valía en Inversion en FIBRAS	9,141	(126,585)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	16,004	12,164			
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	-	2,496			
Inversión en valores extranjeros de deuda	173,476	149,874			
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	(7,845)	(1,971)			
Inversión en títulos Fiduciarios	4,909,682	4,023,742			
Plus (minus) valía en Títulos Fiduciarios	347,887	262,823			
Inversión en Fondos Mutuos	2,309,781	2,313,387			
Plus (Minus) valía de Fondos Mutuos	(387,497)	(70,111)			
	56,333,661	48,778,981			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	367,913	244,851			
Dividendos o derechos por cobrar	21	22			
Intereses devengados sobre valores	564,087	413,955			
Reportos	3,397,595	1,582,026			
Reembolsos y otros intereses	1,447	898			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	556,841	693,302			
	4,887,905	2,935,053			
TOTAL ACTIVO	61,807,811	52,048,656			
			CAPITAL CONTABLE	2023	2022
			CAPITAL		
			CAPITAL CONTRIBUIDO	51,648,280	42,175,303
			Capital social pagado	49,878,333	41,620,717
			Prima en venta de acciones	1,769,946	554,587
			CAPITAL GANADO	8,882,678	8,104,125
			Resultados de ejercicios anteriores	7,804,253	7,730,812
			Resultados del ejercicio	1,078,425	373,312
			OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
			PLUS (MINUS) VALÍAS	(715,219)	128,324
			TOTAL CAPITAL CONTABLE	59,815,738	50,407,752
			TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	61,807,811	52,048,656

CUENTAS DE ORDEN	2023	2022	CUENTAS DE ORDEN	2023	2022
Valores entregados en custodia	56,195,658	48,610,921	Capital social autorizado	35,000,100	35,000,100
Colaterales recibidos por reportos	3,400,830	1,582,360	Acciones emitidas	35,000,100,000	35,000,100,000
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	165,051	213,320	Acciones en circulación, posición propia	21,710,619	18,780,540
Bancos divisas en moneda extranjera	30,864	9,880	Acciones de Siefores, posición de terceros	1	1
Dólares americanos	11,345	9,682	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	4,011,628,559	3,346,818,429
Euros	19,491	-			
Otras Divisas	27	198			
Divisas por recibir	-	6,964			
Dólares americanos	-	6,964			
Divisas por entregar	17,660	12,892			
Dólares americanos	17,660	12,892			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	1,805,808	2,074,189			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	30,545,855	40,322,059			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	13,901,843	14,810,294			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	4,797,015	5,396,422			
Contratos Adelantados sobre Euros	1,310,630	487,699			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	891,636	540,364			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	6,897,105	8,861,756			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	689,416	2,056,099			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	163,629	336,393			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	48,941	48,941			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	1,781,575	5,910,125			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	64,065	1,873,471			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	-	494			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	19,008,255	25,500,544			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	1,926,359	1,966,989			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	6,370,125	3,424,750			
Contratos Adelantados sobre Euros	57,229	722,221			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	756,045	106,392			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	1,172,000	5,300,550			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	409,088	2,374,170			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	702,414	702,414			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	62,888	62,888			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	6,692,834	8,614,214			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	810,333	2,177,015			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	48,941	48,941			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	-\$	715,219	\$	128,324
Un valor de los activos netos de:	\$	59,815,738	\$	50,407,752
El precio de la acción de:	\$	14.830327	\$	14.977349

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 90-94, 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	3,799,162	4,176,467
Intereses, dividendos, premios y derechos	726,956	666,962
Resultado cambiario / Otros productos	(94,517)	(25,954)
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	750,706	(466,591)
INGRESOS NETOS	5,182,306	4,350,883
Costo de ventas de valores	4,015,116	3,904,171
Gastos generales	3,931	3,556
Comisiones sobre saldos	82,234	66,916
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	2,601	2,928
EGRESOS NETOS	4,103,881	3,977,571
UTILIDAD DE OPERACIÓN	1,078,425	373,312
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	649,160	(1,608,311)
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	1,727,585	(1,234,999)

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