

**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 JUNIO DE 2022 Y 2021**

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2022	2021	PASIVO	2022	2021
<b>DISPONIBLE</b>			<b>OBLIGACIONES</b>		
Bancos moneda nacional	116,129	10	Acreedores	307,305	37,168
Bancos monedas extranjeras	30,380	41,494	Provisiones para gastos	3,550	4,717
Divisas por recibir	36,948	124,167	Divisas por entregar	31,731	-
	<b>183,457</b>	<b>165,671</b>	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	4,097,744	5,133,752
<b>RESERVADOS</b>			<b>TOTAL PASIVO</b>	<b>4,440,331</b>	<b>5,175,637</b>
Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en divisas	4,479	-			
	<b>4,479</b>	<b>-</b>			
<b>INVERSIONES</b>			<b>CAPITAL CONTABLE</b>	<b>2022</b>	<b>2021</b>
Inversión en valores de renta variable	13,467,043	8,755,328	<b>CAPITAL</b>		
Plus (Minus) valia en valores de renta variable	(1,192,846)	1,212,298	<b>CAPITAL CONTRIBUIDO</b>	<b>(69,477,824)</b>	<b>(67,370,196)</b>
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	23,018,419	17,696,606	Capital soc al pagado	5,685,082	5,849,648
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	3,206,472	3,522,181	Prima en venta de acciones	(75,162,905)	(73,219,844)
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	21,714,748	26,894,046	<b>CAPITAL GANADO</b>	<b>140,270,799</b>	<b>135,906,518</b>
Plus (Minus) valia en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(1,787,232)	62,656	Resultados de ejercicios anteriores	138,437,550	132,469,520
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	1,540,216	1,736,227	Resultados del ejercicio	1,833,248	3,436,998
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	(108,523)	348,967	<b>OTROS RESULTADOS INTEGRALES</b>		
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	3,099,842	2,545,518	PLUS (MINUS) VALÍAS	(108,722)	5,537,066
Plus (Minus) valia instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	(70,171)	256,518			
Inversión en FIBRAS	1,923,182	1,931,340	<b>TOTAL CAPITAL CONTABLE</b>	<b>70,684,252</b>	<b>74,073,388</b>
Plus (Minus) valia en Inversion en FIBRAS	(431,995)	(352,860)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	13,996	-			
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	1,770	12			
Inversión en valores extranjeros de deuda	145,426	145,426			
Plus (Minus) valia en Inversión en valores extranjeros de deuda	(2,156)	10,364			
Inversión en títulos Fiduciarios	3,404,518	2,979,953			
Plus (minus) valia en Títulos Fiduciarios	505,661	236,932			
Valores Prestados	213,773	276,809			
Plus (Minus) valia de valores prestados	(10,907)	3,591			
Inversión en Fondos Mutuos	2,017,054	2,051,643			
Plus (Minus) valia de Fondos Mutuos	(217,025)	236,418			
	<b>70,451,264</b>	<b>70,549,975</b>			
<b>DEUDORES DIVERSOS</b>					
Liquidadora	44,904	71,750			
Div dendos o derechos por cobrar	36	1,368			
Intereses devengados sobre valores	439,640	507,481			
Reportos	1,694,979	3,601,401			
Premios por cobrar por préstamo de valores	3	16			
Intereses devengados sobre valores prestados	1,222	3,175			
Reembolsos y otros intereses	2,451	119			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	2,302,149	4,348,069			
	<b>4,485,384</b>	<b>8,533,380</b>			
<b>TOTAL ACTIVO</b>	<b>75,124,583</b>	<b>79,249,025</b>	<b>TOTAL PASIVO MAS CAPITAL</b>	<b>75,124,583</b>	<b>79,249,025</b>

CUENTAS DE ORDEN	2022	2021	CUENTAS DE ORDEN	2022	2021
Valores entregados en custodia	69,795,230	70,232,946	Capital social autorizado	27,500,100	27,500,100
Valores prestados	202,866	280,400	Acciones emitidas	27,500,100,000	27,500,100,000
Garantías recibidas por valores prestados	209,253	290,426	Acciones en circulación, posición propia	32,434,445	36,590,014
Colaterales recibidos por reportos	1,696,709	3,600,067	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	5,652,647,180	5,813,057,846
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	406,312	849,055			
Bancos divisas en moneda extranjera	1,546	2,084			
Dólares americanos	1,376	2,084			
Otras Divisas	170	-			
Divisas por recibir	1,835	6,238			
Dólares americanos	1,835	6,238			
Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en moneda extranjera	222	-			
Dólares americanos	222	-			
Divisas por entregar	1,576	-			
Dólares americanos	1,576	-			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	2,406,340	2,693,365			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	115,360,744	188,652,564			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	1,215,370	5,968,780			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	1,617,262	3,131,337			
Contratos Adelantados sobre Euros	981,435	4,435,646			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	401,319	884,309			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	50,507,078	38,058,492			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	15,349,183	50,436,867			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	4,027,343	4,567,176			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	337,691	337,691			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	29,731,235	31,491,725			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	11,192,094	49,280,059			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	734	60,483			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	118,619,480	182,416,602			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	-	520,427			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	5,732,209	3,009,310			
Contratos Adelantados sobre Euros	959,418	3,584,736			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	706,743	748,724			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	-	313,821			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	25,998,634	27,230,334			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	12,650,185	50,816,752			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	2,683,983	3,212,648			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	342,826	518,978			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	52,452,934	40,280,641			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	16,754,857	51,842,541			
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:	-\$	108,722	\$	5,537,066
Un valor de los activos netos de:	\$	70,684,252	\$	74,073,388
El precio de la acción de:	\$	12.433287	\$	12.662880

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 JUNIO DE 2022 Y 2021**

(Cifras en miles de pesos)

	<b>2022</b>	<b>2021</b>
Ingresos por la venta de Valores	9,809,462	11,514,305
Intereses, dividendos, premios y derechos	2,355,023	1,770,842
Resultado cambiario / Otros productos	(45,328)	(35,199)
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	(518,605)	766,364
<b>INGRESOS NETOS</b>	<b>11,600,552</b>	<b>14,016,312</b>
Costo de ventas de valores	9,551,146	10,259,122
Gastos generales	7,231	12,715
Comisiones sobre saldos	203,838	301,347
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	5,089	6,130
<b>EGRESOS NETOS</b>	<b>9,767,303</b>	<b>10,579,314</b>
<b>UTILIDAD DE OPERACIÓN</b>	<b>1,833,248</b>	<b>3,436,998</b>
<b>OTROS RESULTADOS INTEGRALES</b>		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(5,838,695)	(2,353,327)
<b>UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO</b>	<b>(4,005,447)</b>	<b>1,083,671</b>

\_\_\_\_\_  
**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.