

**COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO**

**SIFORE SURA BASICA INICIAL, 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	835	10	Acreedores	204,141	53,046
Bancos monedas extranjeras	21,837	18,916	Provisiones para gastos	882	1,050
Divisas por recibir	17,919	5,666	Divisas por entregar	17,978	-
	<b>40,591</b>	<b>24,592</b>	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	477,046	206,454
<b>RESERVADOS</b>			<b>TOTAL PASIVO</b>	<b>700,048</b>	<b>260,549</b>
Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en divisas	2,086	-			
	<b>2,086</b>	<b>-</b>			
<b>INVERSIONES</b>			<b>CAPITAL CONTABLE</b>	<b>2022</b>	<b>2021</b>
Inversión en valores de renta variable	3,706,558	2,214,914	<b>CAPITAL</b>		
Plus (Minus) valia en valores de renta variable	(226,872)	225,940	<b>CAPITAL CONTRIBUIDO</b>	<b>13,872,662</b>	<b>9,776,059</b>
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	2,886,936	1,840,288	Capital soc al pagado	13,140,988	9,652,926
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	105,541	146,945	Prima en venta de acciones	731,674	123,133
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	4,721,222	4,811,107	<b>CAPITAL GANADO</b>	<b>1,516,022</b>	<b>1,325,346</b>
Plus (Minus) valia en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(397,525)	(579)	Resultados de ejercicios anteriores	1,852,439	607,453
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	153,423	144,143	Resultados del ejercicio	(336,417)	717,893
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	(24,627)	16,176	<b>OTROS RESULTADOS INTEGRALES</b>		
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	493,551	107,054	PLUS (MINUS) VALÍAS	(594,082)	361,653
Plus (Minus) valia instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	(6,906)	7,910			
Inversión en FIBRAS	340,694	234,530	<b>TOTAL CAPITAL CONTABLE</b>	<b>14,794,602</b>	<b>11,463,058</b>
Plus (Minus) valia en Inversion en FIBRAS	(32,810)	(31,571)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	7,858	256			
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	256	2			
Inversión en valores extranjeros de deuda	18,239	8,239			
Plus (Minus) valia en Inversión en valores extranjeros de deuda	(1,086)	(39)			
Inversión en títulos Fiduciarios	1,098,295	676,968			
Plus (minus) valia en Títulos Fiduciarios	71,399	(46,034)			
Valores Prestados	-	51,672			
Plus (Minus) valia de valores prestados	-	684			
Inversión en Fondos Mutuos	569,019	552,355			
Plus (Minus) valia de Fondos Mutuos	(81,196)	42,222			
	<b>13,401,969</b>	<b>11,003,184</b>			
<b>DEUDORES DIVERSOS</b>					
Liquidadora	36,119	24,573			
Div dendos o derechos por cobrar	6	113			
Intereses devengados sobre valores	81,074	62,321			
Reportos	1,805,561	449,369			
Premios por cobrar por préstamo de valores	-	1			
Intereses devengados sobre valores prestados	-	629			
Reembolsos y otros intereses	136	11			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	127,108	158,814			
	<b>2,050,004</b>	<b>695,832</b>			
<b>TOTAL ACTIVO</b>	<b>15,494,650</b>	<b>11,723,607</b>	<b>TOTAL PASIVO MAS CAPITAL</b>	<b>15,494,650</b>	<b>11,723,607</b>

CUENTAS DE ORDEN	2022	2021	CUENTAS DE ORDEN	2022	2021
Valores entregados en custodia	13,371,855	10,942,769	Capital social autorizado	35,000,100	35,000,100
Valores prestados	-	52,356	Acciones emitidas	35,000,100,000	35,000,100,000
Garantías recibidas por valores prestados	-	53,990	Acciones en circulación, posición propia	5,881,569	4,993,891
Colaterales recibidos por reportos	1,807,401	448,895	Acciones de Siefores, posición de terceros	1	1
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	(0)	43,089	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	1,056,745,423	775,575,950
Bancos divisas en moneda extranjera	1,099	950			
Dólares americanos	1,032	950			
Otras Divisas	67	-			
Divisas por recibir	890	285			
Dólares americanos	890	285			
Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en moneda extranjera	104	-			
Dólares americanos	104	-			
Divisas por entregar	893	-			
Dólares americanos	893	-			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	614,130	745,759			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	10,814,776	8,201,566			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	3,705,984	2,516,304			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	1,177,267	859,617			
Contratos Adelantados sobre Euros	310,181	822,467			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	243,901	214,576			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	-	64,294			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	3,379,727	1,030,681			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	549,829	784,238			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	184,912	184,912			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	9,788	9,788			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	929,484	702,984			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	323,596	1,002,955			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	106	8,752			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	7,234,913	5,575,818			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	-	144,585			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	1,213,587	806,940			
Contratos Adelantados sobre Euros	299,993	664,695			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	282,575	182,473			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	750,300	523,800			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	426,588	1,105,946			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	156,008	156,008			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	13,421	29,521			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	3,465,356	1,100,356			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	617,297	851,705			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	9,788	9,788			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	-\$	594,082	\$	361,653
Un valor de los activos netos de:	\$	14,794,602	\$	11,463,058
El precio de la acción de:	\$	13.922667	\$	14.685499

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 INICIAL, 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	2,870,172	2,935,006
Intereses, dividendos, premios y derechos	368,671	254,961
Resultado cambiario / Otros productos	(5,528)	(2,793)
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	(735,237)	255,873
<b>INGRESOS NETOS</b>	<b>2,498,078</b>	<b>3,443,047</b>
Costo de ventas de valores	2,792,774	2,680,025
Gastos generales	1,943	2,041
Comisiones sobre saldos	38,420	41,736
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	1,359	1,352
<b>EGRESOS NETOS</b>	<b>2,834,495</b>	<b>2,725,154</b>
<b>UTILIDAD DE OPERACIÓN</b>	<b>(336,417)</b>	<b>717,893</b>
<b>OTROS RESULTADOS INTEGRALES</b>		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(961,783)	(285,669)
<b>UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO</b>	<b>(1,298,201)</b>	<b>432,224</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.