

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 31 DE DICIEMBRE DE 2023 Y 2022

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO		2023	2022	PASIVO		2023	2022
DISPONIBLE				OBLIGACIONES			
	Bancos moneda nacional	10	10	Acreedores		4,839	14,009
	Bancos monedas extranjeras	139,215	52,330	Provisiones para gastos		6,418	5,528
	Divisas por recibir	19,245	817	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)		2,739,975	3,892,463
	158,470	53,157					
INVERSIONES				TOTAL PASIVO		2,751,232	3,912,000
	Inversión en valores de renta variable	8,847,454	12,456,683				
	Plus (Minus) valia en valores de renta variable	(304,036)	(958,853)				
	Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	20,560,426	22,328,334				
	Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	3,193,583	2,965,952				
	Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	21,345,648	21,240,647				
	Plus (Minus) valia en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(827,508)	(1,112,625)				
	Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	1,424,468	1,537,061				
	Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	(221,072)	(93,371)				
	Inversión en Depósito Banxico	8,492	10,930				
	Plus (Minus) valia en Depósito Banxico	3	3				
	Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	1,684,639	2,757,770				
	Plus (Minus) valia instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	72,010	17,999				
	Inversión en FIBRAS	1,795,950	1,923,182				
	Plus (Minus) valia en Inversion en FIBRAS	17,142	(292,814)				
	Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	-	4,992				
	Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	-	26,010				
	Inversión en valores extranjeros de deuda	888,200	430,426				
	Plus (Minus) valia en Inversión en valores extranjeros de deuda	16,462	1,262				
	Inversión en títulos Fiduciarios	3,866,982	3,621,826				
	Plus (minus) valia en Títulos Fiduciarios	(8,889)	616,305				
	Valores Prestados	160,332	256,528				
	Plus (Minus) valia de valores prestados	(11,218)	(16,423)				
	Inversión en Fondos Mutuos	1,947,791	2,086,005				
Plus (Minus) valia de Fondos Mutuos	(269,982)	(254,516)					
	64,186,877	69,553,313					
DEUDORES DIVERSOS							
	Liquidadora	2,922	499				
	Dividendos o derechos por cobrar	1,374	1,305				
	Intereses devengados sobre valores	462,623	440,769				
	Reportos	2,488,572	1,801,441				
	Premios por cobrar por préstamo de valores	5	8				
	Intereses devengados sobre valores prestados	1,083	1,667				
	Reembolsos y otros intereses	51	3,531				
	Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	2,165,777	2,571,957				
		5,122,407	4,821,177				
	TOTAL ACTIVO	69,467,754	74,427,647	TOTAL PASIVO MAS CAPITAL		69,467,754	74,427,647

Cuentas de Orden	2023	2022	Cuentas de Orden	2023	2022
Valores entregados en custodia	64,037,764	68,897,003	Capital social autorizado	27,500,100	27,500,100
Valores prestados	149,113	240,105	Acciones emitidas	27,500,100,000	27,500,100,000
Garantías recibidas por valores prestados	150,390	254,738	Acciones en circulación, posición propia	25,964,174	30,620,679
Colaterales recibidos por reportos	2,491,618	1,801,466	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	4,706,261,294	5,401,627,722
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	367,629	651,862			
Bancos divisas en moneda extranjera	8,193	2,770			
Dólares americanos	8,064	2,226			
Euros	107	156			
Otras Divisas	22	388			
Divisas por recibir	1,134	42			
Dólares americanos	1,134	42			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	1,875,695	1,903,966			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	58,399,358	93,348,677			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	1,076,957	1,370,874			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	2,585,879	1,056,808			
Contratos Adelantados sobre Euros	333,812	330,959			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	678,568	566,523			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	1,677	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	22,764,006	38,476,017			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	7,509,763	10,534,610			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	3,730,833	3,993,366			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	337,691	337,691			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	13,884,872	25,765,110			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	5,495,299	10,915,984			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	-	734			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	60,449,404	96,544,468			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	5,935,125	5,344,629			
Contratos Adelantados sobre Euros	151,032	135,138			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	631,883	966,635			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	10,342,335	22,032,509			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	5,548,873	12,133,893			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	2,459,757	2,683,983			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	342,826	342,826			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	25,784,445	40,626,879			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	8,915,437	11,940,285			
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:	\$	1,656,496	\$	872,918	
Un valor de los activos netos de:	\$	66,716,522	\$	70,515,647	
El precio de la acción de:	\$	14.098340	\$	12.980932	

GABRIEL VILLAGÓMEZ GÓMEZ Contador General de SIEFORE Declaro bajo protesta de decir verdad que los datos contenidos son auténticos y veraces	EMILIO BERTRÁN RODRÍGUEZ Director General Declaro bajo protesta de decir verdad que los datos contenidos son auténticos y veraces
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 31 DE DICIEMBRE DE 2023 Y 2022

(Cifras en miles de pesos)

	2023	2022
Ingresos por la venta de Valores	13,534,881	23,028,552
Intereses, dividendos, premios y derechos	4,114,198	4,438,208
Resultado cambiario / Otros productos	(89,918)	37,297
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	1,109,910	(173,061)
INGRESOS NETOS	18,669,071	27,330,996
Costo de ventas de valores	13,521,191	23,011,466
Gastos generales	11,747	13,662
Comisiones sobre saldos	385,801	407,072
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	8,666	9,638
EGRESOS NETOS	13,927,405	23,441,838
UTILIDAD DE OPERACIÓN	4,741,668	3,889,158
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	783,578	(4,857,055)
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	5,525,246	(967,897)

GABRIEL VILLAGÓMEZ GÓMEZ

Contador General de SIEFORE

Declaro bajo protesta de decir verdad que los datos contenidos son auténticos y veraces

EMILIO BERTRÁN RODRÍGUEZ

Director General

Declaro bajo protesta de decir verdad que los datos contenidos son auténticos y veraces

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.