

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

SIEFORE SURA BASICA 75-79, 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		15,900	74,207
	Bancos monedas extranjeras	671,472	240,860	Provisiones para gastos		16,966	12,895
	Divisas por recibir	107,924	874	Divisas por entregar		6	-
	779,406	241,744	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)		3,894,556	6,137,310	
INVERSIONES				TOTAL PASIVO		3,927,428	6,224,412
	Inversión en valores de renta variable	29,807,906	28,407,081				
	Plus (Minus) valia en valores de renta variable	928,443	(1,013,271)				
	Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	43,591,029	38,443,798				
	Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	5,432,991	4,212,577				
	Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	47,899,400	43,826,772				
	Plus (Minus) valia en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(2,393,720)	(3,201,988)				
	Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	2,519,825	2,632,991	CAPITAL CONTABLE		2023	2022
	Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	(458,701)	(236,974)				
	Inversión en Depósito Banxico	48,239	20,619	CAPITAL			
	Plus (Minus) valia en Depósito Banxico	16	5	CAPITAL CONTRIBUIDO		50,107,259	43,711,705
	Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	2,035,382	3,942,590	Capital social pagado		55,922,466	53,613,299
	Plus (Minus) valia instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	(79,181)	(22,249)	Prima en venta de acciones		(5,815,207)	(9,901,594)
	Inversión en FIBRAS	4,469,204	3,998,667	CAPITAL GANADO		110,968,007	101,325,491
	Plus (Minus) valia en Inversion en FIBRAS	45,474	(526,948)	Resultados de ejercicios anteriores		101,325,491	98,266,176
	Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	-	60,494	Resultados del ejercicio		9,642,516	3,059,315
	Inversión en valores extranjeros de deuda	1,376,070	915,009	OTROS RESULTADOS INTEGRALES			
	Plus (Minus) valia en Inversión en valores extranjeros de deuda	(3,024)	(17,348)	PLUS (MINUS) VALÍAS		2,293,306	(723,247)
	Inversión en títulos Fiduciarios	16,102,400	14,212,053	TOTAL CAPITAL CONTABLE		163,368,572	144,313,949
	Plus (minus) valia en Títulos Fiduciarios	(339,167)	880,532				
	Valores Prestados	-	294,900				
	Plus (Minus) valia de valores prestados	-	(23,517)				
	Inversión en Fondos Mutuos	5,835,605	6,040,396				
	Plus (Minus) valia de Fondos Mutuos	(839,824)	(774,066)				
	155,978,367	142,072,123					
DEUDORES DIVERSOS							
	Liquidadora	12,703	531				
	Dividendos o derechos por cobrar	998	2,897				
	Intereses devengados sobre valores	1,014,323	884,871				
	Reportos	5,930,093	3,611,120				
	Premios por cobrar por préstamo de valores	-	17				
	Intereses devengados sobre valores prestados	-	5,558				
	Reembolsos y otros intereses	178	7,052				
	Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	3,579,932	3,712,448				
		10,538,227	8,224,494				
	TOTAL ACTIVO	167,296,000	150,538,361	TOTAL PASIVO MAS CAPITAL		167,296,000	150,538,361

Cuentas de Orden	2023	2022	Cuentas de Orden	2023	2022
Valores entregados en custodia	155,978,367	140,975,420	Capital social autorizado	126,259,200	126,259,200
Valores prestados	-	271,384	Acciones emitidas	25,000,019,801	25,000,019,801
Garantías recibidas por valores prestados	-	283,086	Acciones en circulación, posición propia	57,447,571	57,139,853
Colaterales recibidos por reportos	5,936,051	3,611,171	Acciones de Siefores, posición de terceros	2	2
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	983,971	520,334	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	11,015,509,922	10,558,589,922
Bancos divisas en moneda extranjera	39,555	12,758			
Dólares americanos	39,394	10,988			
Euros	111	130			
Otras Divisas	50	1,640			
Divisas por recibir	6,361	45			
Dólares americanos	6,361	45			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	5,823,730	5,919,911			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	112,209,175	138,670,069			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	23,018,235	22,883,936			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	13,526,664	5,176,579			
Contratos Adelantados sobre Euros	1,068,740	791,382			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	2,921,472	2,236,862			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	22,923	12,934			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	36,515,750	52,494,867			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	12,138,337	15,698,922			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	4,454,404	4,454,404			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	249,598	249,598			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	15,187,536	22,874,611			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	3,105,516	11,794,267			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	-	1,708			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	89,236,644	120,404,455			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	13,329,988	7,408,035			
Contratos Adelantados sobre Euros	1,133,827	1,157,723			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	3,133,750	3,973,943			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	11,145,319	18,739,834			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	4,265,476	13,606,271			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	3,184,497	3,184,497			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	236,239	236,239			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	39,090,443	54,820,224			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	13,467,507	17,028,092			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	249,598	249,598			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:					
Una plus (minus) valía de:	\$	2,293,306	-\$	723,247	
Un valor de los activos netos de:	\$	163,368,572	\$	144,313,949	
El precio de la acción de:	\$	14.753834	\$	13.594350	

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 75-79, 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	21,706,663	35,316,060
Intereses, dividendos, premios y derechos	8,711,737	8,334,527
Resultado cambiario / Otros productos	(475,068)	432,285
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	3,780,259	(4,322,394)
INGRESOS NETOS	33,723,591	39,760,478
Costo de ventas de valores	23,167,881	35,856,580
Gastos generales	23,393	25,583
Comisiones sobre saldos	865,014	791,830
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	24,787	27,170
EGRESOS NETOS	24,081,075	36,701,163
UTILIDAD DE OPERACIÓN	9,642,516	3,059,315
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	3,016,554	(8,570,154)
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	12,659,070	(5,510,839)

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.