

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

SIEFORE SURA BASICA 80-84, 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	Bancos moneda nacional	11	10	OBLIGACIONES	Acreedores	15,160	91,169
	Bancos monedas extranjeras	637,581	369,339		Provisiones para gastos	16,159	12,250
	Divisas por recibir	108,476	-		Divisas por entregar	3	-
		746,068	369,349		Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	1,616,573	2,907,575
INVERSIONES	Inversión en valores de renta variable	28,300,423	27,668,168	TOTAL PASIVO		1,647,895	3,010,994
	Plus (Minus) valia en valores de renta variable	1,066,350	(981,001)				
	Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	35,789,283	29,212,290	CAPITAL CONTABLE			
	Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	3,750,662	2,598,543				
	Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	46,250,235	41,712,797				
	Plus (Minus) valia en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(2,335,415)	(3,122,308)				
	Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	2,168,476	2,238,558				
	Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	(461,917)	(283,788)				
	Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	1,692,203	3,311,333		CAPITAL		
	Plus (Minus) valia instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	1,996	1,880		CAPITAL CONTRIBUIDO	116,428,393	108,123,779
	Inversión en FIBRAS	3,994,355	3,358,441		Capital social pagado	116,894,904	109,994,165
	Plus (Minus) valia en Inversion en FIBRAS	118,027	(378,493)		Prima en venta de acciones	(466,511)	(1,870,386)
	Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	1,770	-				
	Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	-	59,085		CAPITAL GANADO	31,048,350	22,370,658
	Inversión en valores extranjeros de deuda	730,910	730,910		Resultados de ejercicios anteriores	22,370,658	20,771,764
	Plus (Minus) valia en Inversión en valores extranjeros de deuda	(8,618)	(13,580)		Resultados del ejercicio	8,677,692	1,598,894
	Inversión en títulos Fiduciarios	14,413,510	11,922,147				
	Plus (minus) valia en Títulos Fiduciarios	(17,839)	1,086,794		OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
	Valores Prestados	347,545	242,807		PLUS (MINUS) VALÍAS	1,234,123	(1,918,297)
	Plus (Minus) valia de valores prestados	(17,560)	(16,654)				
	Inversión en Fondos Mutuos	5,914,260	6,172,630	TOTAL CAPITAL CONTABLE		148,710,866	128,576,140
	Plus (Minus) valia de Fondos Mutuos	(861,563)	(809,690)				
DEUDORES DIVERSOS		140,837,093	124,710,869	TOTAL PASIVO MAS CAPITAL			
	Liquidadora	13,557	412				
	Dividendos o derechos por cobrar	59	1,370				
	Intereses devengados sobre valores	899,879	808,984				
	Reportos	5,887,354	4,480,560				
	Premios por cobrar por préstamo de valores	14	14				
	Intereses devengados sobre valores prestados	6,686	4,632				
	Reembolsos y otros intereses	186	3,226				
	Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	1,967,865	1,207,718				
		8,775,600	6,506,916				
TOTAL ACTIVO		150,358,761	131,587,134			150,358,761	131,587,134

Cuentas de Orden	2023	2022	Cuentas de Orden	2023	2022
Valores entregados en custodia	140,505,337	124,099,831	Capital social autorizado	35,000,100	35,000,100
Valores prestados	329,983	226,153	Acciones emitidas	35,000,100,000	35,000,100,000
Garantías recibidas por valores prestados	347,286	235,905	Acciones en circulación, posición propia	60,622,182	59,187,839
Colaterales recibidos por reportos	5,894,726	4,480,867	Acciones de Siefores, posición de terceros	1	1
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	1,182,955	307,835	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	11,628,868,182	10,940,228,625
Bancos divisas en moneda extranjera	37,556	19,351			
Dólares americanos	37,392	17,538			
Euros	113	140			
Otras Divisas	51	1,673			
Divisas por recibir	6,393	-			
Dólares americanos	6,393	-			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	5,023,239	5,113,205			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	70,537,023	76,007,939			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	24,699,311	25,055,680			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	13,214,779	5,823,248			
Contratos Adelantados sobre Euros	1,195,187	788,501			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	2,763,985	2,442,805			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	60,942	15,003			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	17,249,097	27,063,122			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	7,751,742	5,393,986			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	1,268,099	1,622,069			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	161,504	161,504			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	1,638,050	5,190,350			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	534,328	2,450,003			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	-	1,668			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	44,648,146	53,369,483			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	12,732,752	7,228,406			
Contratos Adelantados sobre Euros	1,050,342	974,861			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	1,930,620	2,980,190			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	426,900	3,979,200			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	1,147,412	3,882,085			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	1,416,521	1,416,521			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	203,915	203,915			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	17,463,886	26,786,263			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	8,114,294	5,756,538			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	161,504	161,504			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:					
Una plus (minus) valía de:	\$	1,234,123	-\$	1,918,297	
Un valor de los activos netos de:	\$	148,710,866	\$	128,576,140	
El precio de la acción de:	\$	12.721758	\$	11.689360	

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 80-84, 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	21,996,485	32,205,573
Intereses, dividendos, premios y derechos	7,696,695	7,292,236
Resultado cambiario / Otros productos	(267,972)	138,633
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	3,687,276	(4,838,828)
INGRESOS NETOS	33,112,484	34,797,614
Costo de ventas de valores	23,605,424	32,445,841
Gastos generales	25,303	26,995
Comisiones sobre saldos	778,945	698,284
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	25,121	27,600
EGRESOS NETOS	24,434,793	33,198,720
UTILIDAD DE OPERACIÓN	8,677,692	1,598,894
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	3,152,420	(8,053,557)
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	11,830,112	(6,454,663)

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.