

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

SIEFORE SURA BASICA 85-89, 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	13,708	71,878	
	Bancos monedas extranjeras	535,657	157,967		Provisiones para gastos	12,552	9,186	
	Divisas por recibir	90,068	767		Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	3,042,179	4,484,137	
	625,735	158,744			TOTAL PASIVO	3,068,439	4,565,201	
INVERSIONES	Inversión en valores de renta variable	23,642,205	22,638,000					
	Plus (Minus) valia en valores de renta variable	858,226	(856,800)					
	Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	27,799,913	22,073,144					
	Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	2,425,517	1,548,636					
	Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	36,724,289	32,512,414					
	Plus (Minus) valia en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(1,728,970)	(2,432,067)					
	Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	1,534,141	1,484,637					
	Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	(354,097)	(237,174)					
	Inversión en Depósito Banxico	-	10,380					
	Plus (Minus) valia en Depósito Banxico	-	3					
	Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	1,569,533	2,281,746					
	Plus (Minus) valia instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	(49,474)	(8,045)					
	Inversión en FIBRAS	3,085,361	2,294,130					
	Plus (Minus) valia en Inversion en FIBRAS	166,319	(200,993)					
	Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	-	37,713					
	Inversión en valores extranjeros de deuda	533,805	533,805					
	Plus (Minus) valia en Inversión en valores extranjeros de deuda	(18,597)	(20,881)					
	Inversión en títulos Fiduciarios	10,832,113	8,762,242					
	Plus (minus) valia en Títulos Fiduciarios	(21,070)	796,969					
	Valores Prestados	488,399	86,412					
	Plus (Minus) valia de valores prestados	(27,321)	(6,376)					
	Inversión en Fondos Mutuos	4,456,370	4,614,491					
	Plus (Minus) valia de Fondos Mutuos	(668,158)	(622,463)					
	111,248,504	95,289,923						
DEUDORES DIVERSOS								
	Liquidadora	12,679	342					
	Dividendos o derechos por cobrar	336	962					
	Intereses devengados sobre valores	707,710	620,783					
	Reportos	4,907,625	3,356,705					
	Premios por cobrar por préstamo de valores	20	3					
	Intereses devengados sobre valores prestados	9,344	556					
	Reembolsos y otros intereses	146	104					
	Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	3,190,682	3,199,065					
		8,828,542	7,178,520					
TOTAL ACTIVO	120,702,781	102,627,187		TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	120,702,781	102,627,187		

Cuentas de Orden	2023	2022	Cuentas de Orden	2023	2022
Valores entregados en custodia	110,787,425	95,172,174	Capital social autorizado	126,259,200	126,259,200
Valores prestados	461,078	80,035	Acciones emitidas	25,000,019,801	25,000,019,801
Garantías recibidas por valores prestados	483,180	85,061	Acciones en circulación, posición propia	38,720,005	36,474,399
Colaterales recibidos por reportos	4,913,267	3,356,753	Acciones de Siefores, posición de terceros	2	2
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	1,171,117	191,075	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	7,425,838,775	6,738,843,809
Bancos divisas en moneda extranjera	31,550	8,451			
Dólares americanos	31,378	6,918			
Euros	131	121			
Otras Divisas	42	1,412			
Divisas por recibir	5,309	39			
Dólares americanos	5,309	39			
Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en moneda extranjera	2,448	-			
Dólares americanos	2,448	-			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	3,416,310	3,442,507			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	92,498,709	108,016,200			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	20,700,644	21,111,030			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	11,338,234	5,825,376			
Contratos Adelantados sobre Euros	977,758	629,114			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	2,153,578	1,946,408			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	90,574	124,681			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	27,685,581	36,615,827			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	9,234,837	9,436,991			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	2,280,760	2,663,307			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	119,905	119,905			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	13,389,940	18,589,179			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	4,526,899	10,953,318			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	-	1,065			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	69,580,712	87,519,792			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	10,054,722	6,031,574			
Contratos Adelantados sobre Euros	858,747	787,404			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	1,391,011	2,418,688			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	12,410,163	17,609,403			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	4,305,239	11,331,695			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	2,179,600	2,179,600			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	123,685	123,685			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	27,719,510	36,297,555			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	10,418,129	10,620,284			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	119,905	119,905			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:					
Una plus (minus) valía de:	\$	582,374	-\$	2,039,191	
Un valor de los activos netos de:	\$	117,634,342	\$	98,061,986	
El precio de la acción de:	\$	15.759048	\$	14.473414	

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 85-89, 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	18,498,101	24,489,162
Intereses, dividendos, premios y derechos	5,900,235	5,326,791
Resultado cambiario / Otros productos	(215,969)	71,227
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	2,901,199	(4,304,069)
INGRESOS NETOS	27,083,566	25,583,111
Costo de ventas de valores	19,755,001	24,764,862
Gastos generales	604,714	22,764
Comisiones sobre saldos	20,650	524,581
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	18,654	20,366
EGRESOS NETOS	20,399,019	25,332,573
UTILIDAD DE OPERACIÓN	6,684,547	250,538
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	2,621,565	(5,776,659)
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	9,306,112	(5,526,121)

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.