

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

SIEFORE SURA BASICA 90-94, 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	8,445	42,545
	Bancos monedas extranjeras	332,994	67,736		Provisiones para gastos	7,258	4,995
	Divisas por recibir	56,408	-		Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	689,569	1,228,807
		389,413	67,746		TOTAL PASIVO	705,272	1,276,347
INVERSIONES	Inversión en valores de renta variable	14,485,901	13,344,257	CAPITAL CONTABLE	CAPITAL	2023	2022
	Plus (Minus) valia en valores de renta variable	461,007	(527,412)				
	Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	16,798,181	12,274,608				
	Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	1,308,703	781,420				
	Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	22,561,626	18,920,894				
	Plus (Minus) valia en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(1,033,744)	(1,456,533)				
	Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	927,806	773,984				
	Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	(199,167)	(128,086)				
	Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	737,056	1,437,148				
	Plus (Minus) valia instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	48,803	26,205				
	Inversión en FIBRAS	1,779,506	1,323,510				
	Plus (Minus) valia en Inversion en FIBRAS	150,316	(86,914)				
	Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	-	17,495				
	Inversión en valores extranjeros de deuda	173,476	173,476				
	Plus (Minus) valia en Inversión en valores extranjeros de deuda	(7,357)	(7,844)				
	Inversión en títulos Fiduciarios	6,230,263	4,866,639				
	Plus (minus) valia en Títulos Fiduciarios	(79,136)	372,786				
	Valores Prestados	484,848	-				
	Plus (Minus) valia de valores prestados	(23,770)	-				
	Inversión en Fondos Mutuos	2,387,991	2,433,558				
	Plus (Minus) valia de Fondos Mutuos	(363,998)	(338,002)				
DEUDORES DIVERSOS		66,828,311	54,201,189	CAPITAL CONTRIBUIDO	Capital social pagado	59,197,562	49,072,890
	Liquidadora	8,793	177				
	Dividendos o derechos por cobrar	39	328				
	Intereses devengados sobre valores	419,309	349,296				
	Reportos	3,417,770	1,809,080				
	Premios por cobrar por préstamo de valores	20	-				
	Intereses devengados sobre valores prestados	9,344	-				
	Reembolsos y otros intereses	82	1,333				
	Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	905,632	359,961				
		4,760,989	2,520,175				
TOTAL ACTIVO		71,978,713	56,789,110	CAPITAL GANADO	Resultados de ejercicios anteriores	11,814,222	7,804,252
				CAPITAL GANADO	Resultados del ejercicio	7,804,253	7,730,812
				OTROS RESULTADOS INTEGRALES	PLUS (MINUS) VALÍAS	261,657	(1,364,379)
TOTAL PASIVO MAS CAPITAL				TOTAL CAPITAL CONTABLE		71,273,441	55,512,763

Cuentas de Orden	2023	2022	Cuentas de Orden	2023	2022
Valores entregados en custodia	66,367,233	54,050,296	Capital social autorizado	35,000,100	35,000,100
Valores prestados	461,078	-	Acciones emitidas	35,000,100,000	35,000,100,000
Garantías recibidas por valores prestados	483,180	-	Acciones en circulación, posición propia	23,537,819	20,770,378
Colaterales recibidos por reportos	3,421,938	1,809,106	Acciones de Siefores, posición de terceros	1	1
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	602,402	12,914	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	4,519,965,921	3,838,823,683
Bancos divisas en moneda extranjera	19,612	3,690			
Dólares americanos	19,478	2,715			
Euros	106	102			
Otras Divisas	27	873			
Divisas por recibir	3,325	-			
Dólares americanos	3,325	-			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	1,727,018	1,707,260			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	33,500,449	30,447,826			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	13,476,172	12,402,986			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	6,807,050	3,699,838			
Contratos Adelantados sobre Euros	810,192	358,642			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	1,239,236	1,034,343			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	226,436	112,265			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	6,766,386	9,831,756			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	2,534,368	506,979			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	163,629	336,393			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	48,941	48,941			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	1,363,975	2,051,125			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	64,065	64,065			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	-	494			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	18,340,616	18,711,157			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	5,556,846	3,777,369			
Contratos Adelantados sobre Euros	530,652	455,836			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	1,060,110	1,445,287			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	754,400	1,441,550			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	381,247	564,763			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	702,414	702,414			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	62,888	62,888			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	6,587,834	9,584,214			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	2,655,284	627,895			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	48,941	48,941			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:					
Una plus (minus) valía de:	\$	261,657	-\$	1,364,379	
Un valor de los activos netos de:	\$	71,273,441	\$	55,512,763	
El precio de la acción de:	\$	15.686890	\$	14.383057	

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 90-94, 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	11,017,449	12,914,183
Intereses, dividendos, premios y derechos	3,497,236	2,922,222
Resultado cambiario / Otros productos	(154,751)	73,508
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	1,819,872	(2,462,682)
INGRESOS NETOS	16,179,806	13,447,231
Costo de ventas de valores	11,793,859	13,061,639
Gastos generales	12,779	13,430
Comisiones sobre saldos	353,417	288,136
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	9,782	10,586
EGRESOS NETOS	12,169,837	13,373,791
UTILIDAD DE OPERACIÓN	4,009,969	73,440
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	1,626,036	(3,101,014)
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	5,636,005	(3,027,574)

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.