

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 MARZO DE 2023 Y 2022

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2023	2022	PASIVO	2023	2022
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	27	10	Acreedores	1,433,459	497,460
Bancos monedas extranjeras	971,224	681,305	Provisiones para gastos	13,510	9,694
Divisas por recibir	782	469,179	Divisas por entregar	289,728	744,771
	972,033	1,150,493	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	4,297,783	5,576,802
INVERSIONES			TOTAL PASIVO	6,034,480	6,828,728
Inversión en valores de renta variable	28,331,339	25,566,239			
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	(272,571)	1,654,664			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	39,445,398	37,064,547			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	4,573,572	4,056,594			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	44,559,368	43,859,699			
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(2,920,326)	(2,706,937)			
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	2,802,962	2,644,618			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	(414,396)	159,145			
Inversión en Depósito Banxico	20,707	4,894	CAPITAL CONTABLE	2023	2022
Plus (Minus) valía en Depósito Banxico	347	94	CAPITAL		
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	2,241,135	2,306,200	CAPITAL CONTRIBUIDO	45,624,693	38,448,320
Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	(15,896)	(40,628)	Capital social pagado	54,305,416	51,597,670
Inversión en FIBRAS	4,275,415	3,874,611	Prima en venta de acciones	(8,680,723)	(13,149,349)
Plus (Minus) valía en Inversión en FIBRAS	(289,679)	(636,529)	CAPITAL GANADO	104,128,478	100,252,208
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	41,152	6,384	Resultados de ejercicios anteriores	101,325,490	98,266,176
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	-	8,630	Resultados del ejercicio	2,802,988	1,986,032
Inversión en valores extranjeros de deuda	1,165,009	540,202	OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	(13,628)	(10,767)	PLUS (MINUS) VALÍAS	654,045	3,145,479
Inversión en títulos Fiduciarios	14,267,757	12,312,954			
Plus (minus) valía en Títulos Fiduciarios	925,220	743,171			
Valores Prestados	1,096,359	398,189	TOTAL CAPITAL CONTABLE	150,407,217	141,846,008
Plus (Minus) valía de valores prestados	(9,327)	(2,206)			
Inversión en Fondos Mutuos	5,790,834	5,779,354			
Plus (Minus) valía de Fondos Mutuos	(909,270)	(71,121)			
	144,691,479	137,512,001			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	951,637	1,169,607			
Dividendos o derechos por cobrar	65	66			
Intereses devengados sobre valores	1,480,452	1,288,760			
Reportos	4,898,876	3,349,630			
Premios por cobrar por préstamo de valores	46	8			
Intereses devengados sobre valores prestados	29,097	5,215			
Reembolsos y otros intereses	7,799	3,118			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	3,410,213	4,195,836			
	10,778,185	10,012,241			
TOTAL ACTIVO	156,441,697	148,674,735	TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	156,441,697	148,674,735

CUENTAS DE ORDEN	2023	2022	CUENTAS DE ORDEN	2023	2022
Valores entregados en custodia	142,909,471	136,488,979	Capital social autorizado	126,259,200	126,259,200
Valores prestados	1,087,032	395,983	Acciones emitidas	25,000,019,801	25,000,019,801
Garantías recibidas por valores prestados	1,142,998	417,547	Acciones en circulación, posición propia	57,859,898	57,009,847
Colaterales recibidos por reportos	4,900,696	3,350,336	Acciones de Siefores, posición de terceros	2	2
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	320,141	728,243	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	10,694,912,774	10,159,614,132
Bancos divisas en moneda extranjera	52,067	34,303			
Dólares americanos	30,688	33,867			
Euros	21,338	-			
Otras Divisas	42	436			
Divisas por recibir	43	23,564			
Dólares americanos	43	23,564			
Divisas por entregar	16,078	37,405			
Dólares americanos	16,078	37,405			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	6,050,797	7,122,246			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	125,290,998	182,729,380			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	24,063,035	27,793,652			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	6,858,783	13,579,647			
Contratos Adelantados sobre Euros	2,313,798	1,279,812			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	1,894,801	592,941			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	38,473,641	48,389,721			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	15,712,743	26,539,932			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	4,454,404	5,297,405			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	249,598	249,598			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	21,034,351	36,455,011			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	10,235,845	22,549,953			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	-	1,708			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	106,712,173	159,499,424			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	1,954,615	4,626,046			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	11,642,914	12,458,039			
Contratos Adelantados sobre Euros	141,353	1,602,086			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	2,822,273	1,032,742			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	16,992,134	32,320,234			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	11,439,421	24,660,948			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	3,184,497	3,184,497			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	236,239	458,911			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	41,007,216	51,037,221			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	17,041,913	27,869,103			
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:	\$	654,045	\$	3,145,479
Un valor de los activos netos de:	\$	150,407,217	\$	141,846,008
El precio de la acción de:	\$	13.987761	\$	13.883843

GABRIEL VILLAGÓMEZ GÓMEZ
Contador General de SIEFORE

EMILIO BERTRÁN RODRÍGUEZ
Director General

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 MARZO DE 2023 Y 2022

(Cifras en miles de pesos)

	2023	2022
Ingresos por la venta de Valores	5,673,798	13,641,687
Intereses, dividendos, premios y derechos	1,927,098	2,117,248
Resultado cambiario / Otros productos	(347,785)	(51,026)
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	1,812,824	(541,997)
INGRESOS NETOS	9,065,935	15,165,912
Costo de ventas de valores	6,039,337	12,972,739
Gastos generales	6,492	8,132
Comisiones sobre saldos	210,505	191,509
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	6,613	7,500
EGRESOS NETOS	6,262,947	13,179,880
UTILIDAD DE OPERACIÓN	2,802,988	1,986,032
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	1,377,293	(4,701,427)
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	4,180,281	(2,715,395)

GABRIEL VILLAGÓMEZ GÓMEZ
Contador General de SIEFORE

EMILIO BERTRÁN RODRÍGUEZ
Director General

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.
En la Sesión del Consejo de Administración con fecha 31 de Enero de 2023 fueron aprobados los Estados Financieros del 31 de Diciembre de 2022, asimismo los presentes Estados Financieros al 31 de Marzo de 2023 serán aprobados en la Sesión del Consejo de Administración con fecha 3 de Mayo de 2023