

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 30 DE SEPTIEMBRE DE 2022 Y 2021

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2022	2021	PASIVO	2022	2021
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	25	10	Acreedores	897,377	294,256
Bancos monedas extranjeras	74,344	59,622	Provisiones para gastos	13,025	11,682
Divisas por recibir	886,079	-	Divisas por entregar	915,512	92,134
	960,449	59,631	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	5,384,353	1,996,295
RESERVADOS			TOTAL PASIVO	7,210,267	2,394,366
Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en pesos	-	34,620			
	-	34,620			
INVERSIONES			CAPITAL CONTABLE	2022	2021
Inversión en valores de renta variable	28,092,557	20,625,608	CAPITAL		
Plus (Minus) valia en valores de renta variable	(3,802,551)	1,792,371	CAPITAL CONTRIBUIDO	106,807,382	95,120,431
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	27,939,952	24,280,234	Capital soc al pagado	108,845,246	98,810,341
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	1,659,407	3,203,730	Prima en venta de acciones	(2,037,863)	(3,689,910)
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	41,139,571	39,977,956	CAPITAL GANADO	18,843,867	17,327,063
Plus (Minus) valia en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(4,399,270)	(661,749)	Resultados de ejercicios anteriores	20,771,764	8,077,210
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	2,241,065	2,211,080	Resultados del ejercicio	(1,927,897)	9,249,854
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	(410,117)	369,241	OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	4,960,618	974,132	PLUS (MINUS) VALÍAS	(7,743,430)	5,254,284
Plus (Minus) valia instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	(52,046)	28,417	TOTAL CAPITAL CONTABLE	117,907,820	117,701,778
Inversión en FIBRAS	3,348,446	3,140,564			
Plus (Minus) valia en Inversion en FIBRAS	(581,600)	(449,828)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	12,453	4,291			
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	10,712	75			
Inversión en valores extranjeros de deuda	518,910	127,188			
Plus (Minus) valia en Inversión en valores extranjeros de deuda	(36,912)	4,453			
Inversión en títulos Fiduciarios	11,217,129	8,941,446			
Plus (minus) valia en Títulos Fiduciarios	1,078,265	399,626			
Valores Prestados	242,807	725,491			
Plus (Minus) valia de valores prestados	(23,249)	(20,598)			
Inversión en Fondos Mutuos	5,908,844	5,948,207			
Plus (Minus) valia de Fondos Mutuos	(1,175,356)	588,621			
	117,889,635	112,210,556			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	523	286,690			
Div dndos o derechos por cobrar	14,056	13,850			
Intereses devengados sobre valores	1,201,607	904,219			
Reportos	3,190,461	5,070,901			
Premios por cobrar por préstamo de valores	19	4			
Intereses devengados sobre valores prestados	998	16,856			
Reembolsos y otros intereses	2,863	1,118			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	1,857,475	1,497,699			
	6,268,003	7,791,337			
TOTAL ACTIVO	125,118,087	120,096,144	TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	125,118,087	120,096,144

CUENTAS DE ORDEN	2022	2021	CUENTAS DE ORDEN	2022	2021
Valores entregados en custodia	117,297,512	111,214,696	Capital social autorizado	35,000,100	35,000,100
Valores prestados	219,558	704,894	Acciones emitidas	35,000,100,000	35,000,100,000
Garantías recibidas por valores prestados	224,274	753,564	Acciones en circulación, posición propia	58,606,329	61,202,547
Colaterales recibidos por reportos	3,191,147	5,068,302	Acciones de Siefores, posición de terceros	1	1
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	525,281	610,141	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	10,825,918,261	9,819,831,542
Bancos divisas en moneda extranjera	3,800	2,899			
Dólares americanos	3,420	2,899			
Otras Divisas	380	-			
Divisas por recibir	44,100	-			
Dólares americanos	44,100	-			
Divisas por entregar	45,565	4,481			
Dólares americanos	45,565	4,481			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	5,788,941	7,084,850			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	91,898,084	90,867,733			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	27,875,308	24,969,071			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	10,898,706	9,353,088			
Contratos Adelantados sobre Euros	610,115	1,020,813			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	2,632,610	1,853,171			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	199,055	506,066			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	29,652,922	13,403,622			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	6,218,434	10,757,610			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	1,622,069	1,885,839			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	161,504	161,504			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	7,770,350	12,417,350			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	4,255,343	14,537,932			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	1,668	1,668			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	70,458,968	71,553,207			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	2,623,638	4,965,196			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	14,239,179	12,036,041			
Contratos Adelantados sobre Euros	1,078,634	459,734			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	2,531,903	613,227			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	-	40,493			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	6,559,200	11,206,200			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	5,687,425	15,970,014			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	1,416,521	1,416,521			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	203,915	310,177			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	29,376,063	13,253,938			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	6,580,986	11,120,162			
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:	-\$	7,743,430	\$	5,254,284
Un valor de los activos netos de:	\$	117,907,820	\$	117,701,778
El precio de la acción de:	\$	10.832611	\$	11.911889

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 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 30 DE SEPTIEMBRE DE 2022 Y 2021

(Cifras en miles de pesos)

	2022	2021
Ingresos por la venta de Valores	22,026,348	34,726,105
Intereses, dividendos, premios y derechos	5,164,456	4,037,670
Resultado cambiario / Otros productos	4,933	53,231
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	(6,881,143)	2,649,211
INGRESOS NETOS	20,314,595	41,466,218
Costo de ventas de valores	21,678,216	31,478,737
Gastos generales	21,072	23,067
Comisiones sobre saldos	521,620	689,965
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	21,584	24,595
EGRESOS NETOS	22,242,492	32,216,364
UTILIDAD DE OPERACIÓN	(1,927,897)	9,249,854
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(13,878,690)	(4,064,474)
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	(15,806,587)	5,185,379

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 11 de julio de 2022 fueron aprobados los Estados Financieros del 30 de Junio de 2022, asimismo los presentes Estados Financieros al 30 de Septiembre de 2022 serán aprobados en la Sesión del Consejo de Administración con fecha 11 de octubre de 2022