

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 30 DE SEPTIEMBRE DE 2022 Y 2021

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2022	2021	PASIVO	2022	2021
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	18	10	Acreedores	1,526,527	51,094
Bancos monedas extranjeras	59,536	62,180	Provisiones para gastos	9,744	8,588
Divisas por recibir	832,837	5,576	Divisas por entregar	855,080	111,276
	892,391	67,765	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	7,043,700	4,153,416
INVERSIONES			TOTAL PASIVO	9,435,051	4,324,374
Inversión en valores de renta variable	23,161,014	15,643,133			
Plus (Minus) valia en valores de renta variable	(3,147,601)	1,373,198			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	20,262,000	15,472,901			
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	634,922	1,650,865			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	32,032,397	32,820,135			
Plus (Minus) valia en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(3,403,927)	(548,993)			
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	1,485,950	1,401,894			
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	(326,948)	195,490			
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	3,938,839	726,216			
Plus (Minus) valia instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	(65,771)	25,175			
Inversión en FIBRAS	2,207,593	1,951,583			
Plus (Minus) valia en Inversion en FIBRAS	(326,373)	(244,713)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	9,600	967			
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	6,837	48			
Inversión en valores extranjeros de deuda	534,805	64,945			
Plus (Minus) valia en Inversión en valores extranjeros de deuda	(36,358)	2,175			
Inversión en títulos Fiduciarios	7,946,193	6,144,549			
Plus (minus) valia en Títulos Fiduciarios	803,530	252,735			
Valores Prestados	260,417	-			
Plus (Minus) valia de valores prestados	(20,590)	-			
Inversión en Fondos Mutuos	4,400,564	4,398,098			
Plus (Minus) valia de Fondos Mutuos	(897,617)	413,364			
	89,459,478	81,743,764			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	507	59,570			
Dividendos o derechos por cobrar	10,586	10,239			
Intereses devengados sobre valores	871,462	622,964			
Reportos	3,431,086	4,307,088			
Premios por cobrar por préstamo de valores	42	-			
Intereses devengados sobre valores prestados	1,389	-			
Reembolsos y otros intereses	100	-			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	3,935,182	4,068,756			
	8,250,355	9,068,618			
TOTAL ACTIVO	98,602,224	90,880,147			
			CAPITAL CONTABLE	2022	2021
			CAPITAL		
			CAPITAL CONTRIBUIDO	23,623,632	11,342,330
			Capital social pagado	33,644,162	29,359,709
			Prima en venta de acciones	(10,020,530)	(18,017,379)
			CAPITAL GANADO	72,330,275	72,094,147
			Resultados de ejercicios anteriores	74,614,971	65,663,719
			Resultados del ejercicio	(2,284,697)	6,430,428
			OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
			PLUS (MINUS) VALÍAS	(6,786,734)	3,119,296
			TOTAL CAPITAL CONTABLE	89,167,173	86,555,773
			TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	98,602,224	90,880,147

CUENTAS DE ORDEN	2022	2021	CUENTAS DE ORDEN	2022	2021
Valores entregados en custodia	89,203,213	81,742,749	Capital social autorizado	126,259,200	126,259,200
Valores prestados	239,827	-	Acciones emitidas	25,000,019,801	25,000,019,801
Garantías recibidas por valores prestados	246,631	-	Acciones en circulación, posición propia	35,876,794	36,011,547
Colaterales recibidos por reportos	3,431,351	4,304,666	Acciones de Siefores, posición de terceros	2	2
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	286,239	786,834	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	6,625,853,358	5,777,373,135
Bancos divisas en moneda extranjera	3,037	3,024			
Dólares americanos	2,754	3,024			
Otras Divisas	283	-			
Divisas por recibir	41,450	271			
Dólares americanos	41,450	271			
Divisas por entregar	42,557	5,412			
Dólares americanos	42,557	5,412			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	3,895,453	4,797,845			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	122,315,732	160,594,581			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	22,769,329	19,650,317			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	9,700,553	6,538,705			
Contratos Adelantados sobre Euros	499,359	930,043			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	2,068,362	1,667,585			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	-	240,097			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	38,239,016	32,782,601			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	12,178,281	33,755,121			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	2,663,307	3,544,639			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	119,905	119,905			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	21,254,179	27,403,379			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	12,822,376	33,961,126			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	1,065	1,065			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	102,989,137	143,209,861			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	1,489,955	3,562,935			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	11,414,246	6,820,483			
Contratos Adelantados sobre Euros	871,428	415,804			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	2,031,872	516,198			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	-	435,300			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	20,274,403	26,423,603			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	13,285,766	34,649,265			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	2,179,600	2,179,600			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	123,685	266,202			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	37,836,705	32,882,153			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	13,361,573	34,938,413			
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:	-\$	6,786,734	\$	3,119,296
Un valor de los activos netos de:	\$	89,167,173	\$	86,555,773
El precio de la acción de:	\$	13.384987	\$	14.889050

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 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 30 DE SEPTIEMBRE DE 2022 Y 2021**

(Cifras en miles de pesos)

	2022	2021
Ingresos por la venta de Valores	17,984,920	26,782,146
Intereses, dividendos, premios y derechos	3,743,503	2,831,168
Resultado cambiario / Otros productos	(32,403)	26,104
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	(5,959,767)	1,674,558
INGRESOS NETOS	15,736,253	31,313,976
Costo de ventas de valores	17,596,710	24,347,326
Gastos generales	17,976	18,985
Comisiones sobre saldos	390,327	499,308
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	15,936	17,928
EGRESOS NETOS	18,020,950	24,883,548
UTILIDAD DE OPERACIÓN	(2,284,697)	6,430,428
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(10,524,202)	(2,991,695)
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	(12,808,899)	3,438,733

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