

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 JUNIO DE 2022 Y 2021

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2022	2021	PASIVO	2022	2021
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	514,908	10	Acreedores	785,581	916,450
Bancos monedas extranjeras	56,055	30,045	Provisiones para gastos	8,873	11,195
Divisas por recibir	72,279	109,413	Divisas por entregar	73,074	-
	643,242	139,468	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	3,657,806	1,859,453
RESERVADOS			TOTAL PASIVO	4,525,335	2,787,098
Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en divisas	15,107	-			
	15,107	-			
INVERSIONES			CAPITAL CONTABLE	2022	2021
Inversión en valores de renta variable	25,953,969	20,904,596	CAPITAL		
Plus (Minus) valia en valores de renta variable	(1,383,484)	2,397,076	CAPITAL CONTRIBUIDO	104,359,870	92,380,602
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	27,254,928	20,944,930	Capital soc al pagado	106,656,288	96,514,723
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	2,452,918	3,023,353	Prima en venta de acciones	(2,296,419)	(4,134,121)
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	42,763,396	35,947,130	CAPITAL GANADO	19,340,718	15,728,262
Plus (Minus) valia en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(3,638,618)	39,000	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	2,429,304	Resultados del ejercicio	(1,431,046)	7,651,052
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	(294,013)	314,613	OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	3,459,490	1,150,367	PLUS (MINUS) VALÍAS	(3,081,918)	5,922,655
Plus (Minus) valia instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	(33,348)	88,570	TOTAL CAPITAL CONTABLE	120,618,669	114,031,519
Inversión en FIBRAS	3,313,006	3,087,247			
Plus (Minus) valia en Inversion en FIBRAS	(614,708)	(536,171)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	44,229	2,297			
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	4,020	28			
Inversión en valores extranjeros de deuda	465,610	127,188			
Plus (Minus) valia en Inversión en valores extranjeros de deuda	(25,303)	6,745			
Inversión en títulos Fiduciarios	10,918,796	8,242,448			
Plus (minus) valia en Títulos Fiduciarios	1,249,409	(21,783)			
Valores Prestados	449,848	355,969			
Plus (Minus) valia de valores prestados	(81,051)	11,170			
Inversión en Fondos Mutuos	5,908,844	5,911,681			
Plus (Minus) valia de Fondos Mutuos	(713,722)	600,083			
	119,695,282	105,025,841			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	44,931	146,293			
Divendos o derechos por cobrar	90	1,598			
Intereses devengados sobre valores	802,400	669,913			
Reportos	2,493,858	9,414,487			
Premios por cobrar por préstamo de valores	5	14			
Intereses devengados sobre valores prestados	2,078	1,633			
Reembolsos y otros intereses	2,229	1,024			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	1,444,782	1,418,344			
	4,790,372	11,653,307			
TOTAL ACTIVO	125,144,004	116,818,617	TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	125,144,004	116,818,617

CUENTAS DE ORDEN	2022	2021	CUENTAS DE ORDEN	2022	2021
Valores entregados en custodia	118,912,037	104,395,777	Capital social autorizado	35,000,100	35,000,100
Valores prestados	368,797	367,140	Acciones emitidas	35,000,100,000	35,000,100,000
Garantías recibidas por valores prestados	387,691	380,183	Acciones en circulación, posición propia	59,393,140	59,794,948
Colaterales recibidos por reportos	2,492,024	9,418,105	Acciones de Siefores, posición de terceros	1	1
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	569,776	466,811	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	10,606,235,706	9,591,677,353
Bancos divisas en moneda extranjera	2,872	1,509			
Dólares americanos	2,464	1,509			
Otras Divisas	408	-			
Divisas por recibir	3,590	5,496			
Dólares americanos	3,590	5,496			
Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en moneda extranjera	750	-			
Dólares americanos	750	-			
Divisas por entregar	3,629	-			
Dólares americanos	3,629	-			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	6,091,248	7,317,860			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	87,984,551	88,831,656			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	25,477,788	22,613,423			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	7,214,655	7,478,712			
Contratos Adelantados sobre Euros	2,612,235	8,093,461			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	1,686,086	2,060,411			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	-	503,034			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	25,726,922	12,398,186			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	6,547,930	10,093,691			
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	12,678,350	9,507,350			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	4,255,343	13,898,650			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	1,668	137,394			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	64,203,923	68,223,112			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	-	1,257,500			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	9,066,974	10,215,807			
Contratos Adelantados sobre Euros	2,535,726	6,789,057			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	1,304,113	1,699,703			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	-	40,493			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	11,467,200	8,296,200			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	5,687,425	15,330,732			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	1,416,521	1,416,521			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	203,915	384,415			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	25,450,063	12,174,938			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	6,910,482	10,456,243			
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:	-\$	3,081,918	\$	5,922,655
Un valor de los activos netos de:	\$	120,618,669	\$	114,031,519
El precio de la acción de:	\$	11.309101	\$	11.814935

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 JUNIO DE 2022 Y 2021

(Cifras en miles de pesos)

	2022	2021
Ingresos por la venta de Valores	13,846,702	26,082,377
Intereses, dividendos, premios y derechos	3,605,196	2,753,635
Resultado cambiario / Otros productos	(27,125)	(35,573)
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	(5,255,523)	2,733,891
INGRESOS NETOS	12,169,250	31,534,331
Costo de ventas de valores	13,232,907	23,403,625
Gastos generales	12,462	17,586
Comisiones sobre saldos	340,331	446,197
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	14,596	15,870
EGRESOS NETOS	13,600,296	23,883,279
UTILIDAD DE OPERACIÓN	(1,431,046)	7,651,052
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(9,217,178)	(3,396,103)
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	(10,648,225)	4,254,949

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.