

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 30 DE JUNIO DE 2022 Y 2021

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2022	2021	PASIVO	2022	2021
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	248,356	11	Acreedores	876,009	738,814
Bancos monedas extranjeras	62,828	39,067	Provisiones para gastos	9,028	11,494
Divisas por recibir	145,272	157,962	Divisas por entregar	141,166	-
	456,456	197,040	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	6,605,613	5,728,692
INVERSIONES			TOTAL PASIVO	7,631,818	6,479,001
Inversión en valores de renta variable	27,640,977	21,852,556			
Plus (Minus) valia en valores de renta variable	(1,450,734)	2,622,930			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	36,425,063	25,692,141			
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	3,753,229	4,303,035			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	44,926,165	42,435,945			
Plus (Minus) valia en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(3,974,423)	35,589			
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	2,637,427	2,870,790			
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	(245,968)	472,904			
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	3,862,621	2,776,835			
Plus (Minus) valia instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	(76,579)	243,051			
Inversión en FIBRAS	3,968,622	3,764,856			
Plus (Minus) valia en Inversion en FIBRAS	(813,389)	(710,327)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	18,386	-			
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	4,116	29			
Inversión en valores extranjeros de deuda	608,809	231,512			
Plus (Minus) valia en Inversión en valores extranjeros de deuda	(32,103)	10,829			
Inversión en títulos Fiduciarios	12,565,468	9,917,496			
Plus (minus) valia en Títulos Fiduciarios	1,126,620	(67,145)			
Valores Prestados	297,466	405,660			
Plus (Minus) valia de valores prestados	(45,619)	13,928			
Inversión en Fondos Mutuos	5,779,354	5,788,984			
Plus (Minus) valia de Fondos Mutuos	(674,707)	635,881			
	136,300,801	123,297,478			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	31,277	122,184			
Divendos o derechos por cobrar	82	2,278			
Intereses devengados sobre valores	864,086	769,653			
Reportos	3,093,075	9,614,596			
Premios por cobrar por préstamo de valores	3	16			
Intereses devengados sobre valores prestados	1,367	1,867			
Reembolsos y otros intereses	4,540	986			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	3,776,579	4,621,335			
	7,771,009	15,132,914			
TOTAL ACTIVO	144,528,266	138,627,431			
			CAPITAL CONTABLE	2022	2021
			CAPITAL		
			CAPITAL CONTRIBUIDO	41,101,254	31,654,423
			Capital soc al pagado	52,607,814	49,114,742
			Prima en venta de acciones	(11,506,560)	(17,460,320)
			CAPITAL GANADO	98,228,867	92,933,334
			Resultados de ejercicios anteriores	98,266,176	85,500,172
			Resultados del ejercicio	(37,308)	7,433,162
			OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
			PLUS (MINUS) VALÍAS	(2,433,673)	7,560,674
			TOTAL CAPITAL CONTABLE	136,896,448	132,148,431
			TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	144,528,266	138,627,431

CUENTAS DE ORDEN	2022	2021	CUENTAS DE ORDEN	2022	2021
Valores entregados en custodia	135,251,027	122,633,836	Capital social autorizado	126,259,200	126,259,200
Valores prestados	251,847	419,588	Acciones emitidas	25,000,019,801	25,000,019,801
Garantías recibidas por valores prestados	265,723	433,248	Acciones en circulación, posición propia	58,046,757	60,283,784
Colaterales recibidos por reportos	3,093,551	9,616,215	Acciones de Siefores, posición de terceros	2	2
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	578,969	749,329	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	10,358,591,394	9,664,706,779
Bancos divisas en moneda extranjera	3,216	1,963			
Dólares americanos	2,774	1,963			
Otras Divisas	442	-			
Divisas por recibir	7,215	7,935			
Dólares americanos	7,215	7,935			
Divisas por entregar	7,012	-			
Dólares americanos	7,012	-			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	6,995,850	8,281,624			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	157,389,050	206,611,092			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	22,650,549	20,613,831			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	6,829,084	7,271,765			
Contratos Adelantados sobre Euros	2,548,587	8,259,805			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	1,350,770	1,871,894			
Contratos de Opciones sobre Renta Variable Nacional	-	2,803			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	52,661,533	41,398,950			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	19,378,357	43,684,633			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	4,490,821	5,541,250			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	249,598	249,598			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	33,182,411	34,977,075			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	14,045,633	42,598,816			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	1,708	140,672			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	139,052,745	188,323,800			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	-	1,263,448			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	9,539,482	9,292,992			
Contratos Adelantados sobre Euros	2,667,202	6,893,511			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	2,538,462	1,795,742			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	-	328,803			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	29,047,634	29,996,234			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	16,156,628	44,773,077			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	3,184,497	4,030,361			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	236,239	458,911			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	54,725,476	44,227,321			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	20,707,527	45,013,803			
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:	-\$	2,433,673	\$	7,560,674
Un valor de los activos netos de:	\$	136,896,448	\$	132,148,431
El precio de la acción de:	\$	13.142095	\$	13.588541

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 30 DE JUNIO DE 2022 Y 2021

(Cifras en miles de pesos)

	2022	2021
Ingresos por la venta de Valores	17,761,204	25,045,599
Intereses, dividendos, premios y derechos	4,122,374	3,237,704
Resultado cambiario / Otros productos	(28,988)	(62,957)
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	(4,437,253)	2,137,490
INGRESOS NETOS	17,417,337	30,357,835
Costo de ventas de valores	17,039,323	22,365,317
Gastos generales	13,126	19,779
Comisiones sobre saldos	387,833	523,717
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	14,364	15,861
EGRESOS NETOS	17,454,645	22,924,673
UTILIDAD DE OPERACIÓN	(37,308)	7,433,162
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(10,280,580)	(3,834,327)
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	(10,317,888)	3,598,835

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.