

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO
SIEFORE INVERCAP BASICA 60-64 S.A DE C.V., SOCIEDAD DE INVERSIÓN ESPECIALIZADA DE FONDOS PARA EL RETIRO
SOCIEDAD DE INVERSIÓN BÁSICA

ESTADOS DE SITUACION FINANCIERA AL 30 DE SEPTIEMBRE DE 2022 Y 2021

[Cifras en miles de pesos]

	2022	2021		2022	2021
ACTIVO			PASIVO		
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	22,523	12,446	Divisas por entregar	-	10,848
Bancos monedas extranjeras	1,001,218	895,741	Acreedores	122,292	-
	1,023,741	908,187	Provisiones para gastos	928	508
			Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	87,331	12,552
INVERSIONES			Total PASIVO	210,551	23,908
Inversión en valores de renta variable	2,067,822	2,900,471			
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	(204,877)	629,062			
Inversión en instrumentos de deuda nacional de tasa real denominados en pesos y UDIS	8,006,919	7,419,446			
Plus (Minus) valía en instrumentos de deuda nacional de tasa real denominados en pesos y UDIS	358,706	842,934			
Inversión en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal denominados en pesos	4,259,051	5,448,493			
Plus (Minus) valía en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal denominados en pesos	(345,552)	(11,879)			
Inversión en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	51,334	316,665			
Plus (Minus) valía en instrumentos deuda nacional tasa nominal en divisas distintas al peso	19,120	68,913			
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	59,072	46,900			
Plus (Minus) valía en instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	-	3,208			
Inversión en FIBRAS	606,446	570,606			
Plus (Minus) valía en inversión en FIBRAS	(27,395)	9,932			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	11,839	32,116			
Inversión en valores extranjeros de deuda	807,960	60,536			
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	(33,989)	2,286			
Inversión en títulos Fiduciarios	925,961	901,503			
Plus (Minus) valía en Títulos Fiduciarios	(92,385)	(17,173)			
	16,470,032	19,224,019			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	10	7,558			
Dividendos o derechos por cobrar	360	1,605			
Intereses devengados sobre valores	201,563	182,826			
Reportos	194,151	159,021			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	-	3,169			
	396,084	354,179			
TOTAL DE ACTIVO	17,889,857	20,486,385			
CUENTAS DE ORDEN					
Valores entregados en custodia	16,399,121	19,191,903	Capital social autorizado	98,999,100	98,999,100
Colaterales recibidos por Reportos	194,368	159,022	Acciones emitidas	98,999,100,000	98,999,100,000
Garantías Recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	-	3,638	Acciones en circulación posición propia	32,160,269	40,387,228
Bancos divisas en moneda extranjera	49,830	43,562	Acciones de Siefores posición de terceros	1	1
Dólar Americano	49,828	43,561	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	6,088,750,516	6,790,790,579
Euros	2	1			
Divisas por entregar	-	528			
Dólar Americano	-	528			
Compromisos futuros por la adquisición de Títulos Fiduciarios	167,718	195,171			
De Emisor Nacional	167,718	195,171			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición Larga	1,452,563	1,167,170			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	1,452,563	667,170			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	-	500,000			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición Corta	201,904	1,019,104			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	-	279,410			
Contratos Futuros sobre Euros	201,904	239,694			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	-	500,000			
La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:					
	Una plus(minus)valía de :	(326,372)	1,527,283		
	Un valor de activos netos de:	17,679,306	20,462,477		
	El precio de acción de :	2.888346	2.995454		

EDGARDO MISAEL ORTEGA PEREZ
CONTADOR GENERAL DE SIEFORES

Declaro bajo protesta de decir la verdad que los datos contenidos son auténticos y veraces

EDUARDO SALABURU LLAMAS
DIRECTOR GENERAL

Declaro bajo protesta de decir la verdad que los datos contenidos son auténticos y veraces

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 INVERCAP BASICA 60-64 S.A DE C.V., SOCIEDAD DE INVERSIÓN ESPECIALIZADA DE FONDOS PARA EL RETIRO
SOCIEDAD DE INVERSIÓN BÁSICA
ESTADO DE RESULTADO INTEGRAL POR LOS PERIODOS AL 30 DE SEPTIEMBRE DE 2022 Y 2021

[Cifras en miles de pesos]

Concepto	2022	2021
Ingresos por la venta de valores	6,574,988	7,879,730
Intereses, dividendos, premios y derechos	685,315	644,087
Resultado cambiario otros productos	(23,901)	4,208
Resultados por Intermediación con Instrumentos Financieros Derivados	(289,712)	20,019
<u>Ingresos Netos</u>	<u>6,946,690</u>	<u>8,548,044</u>
Costo Venta de Valores	6,313,638	7,221,094
Gastos Generales	1,348	1,734
Comisiones sobre saldos	81,066	136,364
<u>Egresos Netos</u>	<u>6,396,052</u>	<u>7,359,192</u>
<u>Utilidad de Operación</u>	<u>550,638</u>	<u>1,188,852</u>
<u>Otros resultados integrales</u>		
Plus(Minus)valías	(1,689,881)	(658,950)
<u>UTILIDAD INTEGRAL EJERCICIO</u>	<u>(1,139,243)</u>	<u>529,902</u>

EDGARDO MISAEL ORTEGA PEREZ
CONTADOR GENERAL DE SIEFORES

*Declaro bajo protesta de decir la verdad que los
datos contenidos son auténticos y veraces*

EDUARDO SALABURU LLAMAS
DIRECTOR GENERAL

*Declaro bajo protesta de decir la verdad que los
datos contenidos son auténticos y veraces*

El presente estado financiero se formuló 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.