

**COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO
SIEFORE INVERCAP BASICA 80-84 S.A DE C.V., SOCIEDAD DE INVERSIÓN ESPECIALIZADA DE FONDOS PARA EL RETIRO
SOCIEDAD DE INVERSIÓN BÁSICA**

ESTADOS DE SITUACION FINANCIERA AL 31 DE DICIEMBRE DE 2022 Y 2021

[Cifras en miles de pesos]

	2022	2021		2022	2021
ACTIVO			PASIVO		
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	12,919	12,305	Divisas por entregar	554	482
Bancos monedas extranjeras	620,494	1,435,969	Acreedores	-	27,497
	633,413	1,448,274	Provisiones para gastos	1,923	2,396
INVERSIONES			Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	283,560	-
Inversión en valores de renta variable	8,317,500	8,396,847	Total PASIVO	286,037	30,375
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	(258,097)	1,605,387			
Inversión en instrumentos de deuda nacional de tasa real denominados en pesos y UDIS	13,031,492	11,844,406			
Plus (Minus) valía en instrumentos de deuda nacional de tasa real denominados en pesos y UDIS	993,348	1,377,434			
Inversión en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal denominados en pesos	11,966,842	14,137,691			
Plus (Minus) valía en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal denominados en pesos	(496,706)	(74,855)			
Inversión en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	494,352	247,337			
Plus (Minus) valía en instrumentos deuda nacional tasa nominal en divisas distintas al peso	(44,829)	7,631			
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	410,657	203,832			
Plus (Minus) valía en instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	7,969	23,518			
Inversión en FIBRAS	1,361,003	1,295,358			
Plus (Minus) valía en inversión en FIBRAS	(77,275)	(126,714)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	119,159	178,007			
Inversión en valores extranjeros de deuda	1,806,216	29,478			
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	(154,872)	710			
Inversión en títulos Fiduciarios	2,078,587	1,754,185			
Plus (Minus) valía en Títulos Fiduciarios	(181,925)	(68,805)			
	39,373,421	40,831,447			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	27	3			
Dividendos o derechos por cobrar	966	8,976			
Intereses devengados sobre valores	204,601	218,499			
Reportos	1,003,883	350,159			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	-	516,825			
	1,209,477	1,094,462			
TOTAL DE ACTIVO	41,216,311	43,374,183			
CUENTAS DE ORDEN					
Valores entregados en custodia	38,991,202	40,653,440	Capital social autorizado	99,000,000	99,000,000
Colaterales recibidos por Reportos	1,003,808	350,162	Acciones emitidas	9,900,000,000	9,900,000,000
Garantías Recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	-	579,030	Acciones en circulación posición propia	16,660,360	19,264,424
Bancos divisas en moneda extranjera	31,866	70,159	Acciones de Siefos posición de terceros	1	1
Dólar Americano	31,861	70,159	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	3,450,285,485	3,424,216,714
Euros	5	-			
Divisas por entregar	28	24			
Dólar Americano	28	24			
Compromisos futuros por la adquisición de Títulos Fiduciarios	2,967,629	531,866			
De Emisor Nacional	2,967,629	531,866			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición Larga	7,051,507	8,392,451			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	6,805,307	8,392,451			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	246,200	-			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición Corta	1,851,553	2,368,022			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	1,243,467	1,856,257			
Contratos Futuros sobre Euros	361,886	511,765			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	246,200	-			
La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:					
Una plus(minus)valía de :	(212,388)	2,744,306			
Un valor de activos netos de:	40,930,274	43,343,808			
El precio de acción de :	11.805859	12.587206			

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
SIFORE INVERCAP BASICA 80-84 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 31 DE DICIEMBRE DE 2022 Y 2021

[Cifras en miles de pesos]

Concepto	2022	2021
Ingresos por la venta de valores	15,963,325	21,947,579
Intereses, dividendos, premios y derechos	2,109,267	1,652,256
Resultado cambiario otros productos	(99,243)	31,365
Resultados por Intermediación con Instrumentos Financieros Derivados	(1,351,474)	1,665,568
<u>Ingresos Netos</u>	<u>16,621,875</u>	<u>25,296,768</u>
Costo Venta de Valores	16,122,998	20,656,496
Gastos Generales	7,462	9,058
Comisiones sobre saldos	232,145	344,085
<u>Egresos Netos</u>	<u>16,362,605</u>	<u>21,009,639</u>
<u>Utilidad de Operación</u>	<u>259,270</u>	<u>4,287,129</u>
<u>Otros resultados integrales</u>		
Plus(Minus)valías	(2,956,694)	(918,037)
<u>UTILIDAD INTEGRAL EJERCICIO</u>	<u>(2,697,424)</u>	<u>3,369,092</u>

EDGARDO MISAEL ORTEGA PEREZ

CONTADOR GENERAL DE SIFORES

*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.