

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO
SIEFORE INVERCAP BASICA 70-74 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 MARZO DE 2023 Y 2022

[Cifras en miles de pesos]

| | | 2023 | 2022 | | | 2023 | 2022 |
|---|-------------------------------|-------------------|-------------------|---|--|---------------|---------------|
| ACTIVO | | | | PASIVO | | | |
| DISPONIBLE | | | | OBLIGACIONES | | | |
| Bancos moneda nacional | | 12,583 | 12,344 | Acreedores | | - | 9,794 |
| Bancos monedas extranjeras | | 967,905 | 2,276,847 | Provisiones para gastos | | 2,161 | 706 |
| | | 980,488 | 2,289,191 | Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC) | | - | 35,527 |
| | | | | Total PASIVO | | 2,161 | 46,027 |
| INVERSIONES | | | | | | | |
| Inversión en valores de renta variable | | 7,154,080 | 7,529,842 | | | | |
| Plus (Minus) valía en valores de renta variable | | 155,984 | 858,300 | | | | |
| Inversión en instrumentos de deuda nacional de tasa real denominados en pesos y UDIS | | 14,447,892 | 13,971,565 | | | | |
| Plus (Minus) valía en instrumentos de deuda nacional de tasa real denominados en pesos y UDIS | | 1,189,672 | 1,168,116 | | | | |
| Inversión en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal denominados en pesos | | 14,518,450 | 13,805,729 | | | | |
| Plus (Minus) valía en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal denominados en pesos | | (366,432) | (462,048) | | | | |
| Depósito traspaso Banxico | | 26,938 | 35,853 | | | | |
| Plus (Minus) valía en inversión en el Depósito Traspaso Banxico | | 451 | 686 | | | | |
| Inversión en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso | | 516,803 | 168,202 | | | | |
| Plus (Minus) valía en instrumentos deuda nacional tasa nominal en divisas distintas al peso | | (53,775) | (10,566) | | | | |
| Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas | | 241,415 | 79,331 | | | | |
| Plus (Minus) valía en instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas | | 10,240 | 5,813 | | | | |
| Inversión en FIBRAS | | 1,341,764 | 1,428,028 | | | | |
| Plus (Minus) valía en inversión en FIBRAS | | 23,971 | (84,144) | | | | |
| Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados | | 45,198 | 131,180 | | | | |
| Inversión en valores extranjeros de deuda | | 1,717,498 | 462,836 | | | | |
| Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda | | (208,155) | (11,140) | | | | |
| Inversión en títulos Fiduciarios | | 2,663,611 | 2,313,596 | | | | |
| Plus (Minus) valía en Títulos Fiduciarios | | (210,178) | (5,777) | | | | |
| | | 43,215,427 | 41,385,402 | | | | |
| DEUDORES DIVERSOS | | | | | | | |
| Dividendos o derechos por cobrar | | 450 | 456 | | | | |
| Intereses devengados sobre valores | | 463,707 | 415,479 | | | | |
| Reportos | | 1,441,353 | 917,166 | | | | |
| Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC) | | 138,358 | 27,767 | | | | |
| | | 2,043,868 | 1,360,868 | | | | |
| TOTAL DE ACTIVO | | 46,239,783 | 45,035,461 | | | | |
| CUENTAS DE ORDEN | | | | | | | |
| Valores entregados en custodia | | 43,170,230 | 41,254,222 | Capital social autorizado | | 99,000,000 | 99,000,000 |
| Colaterales recibidos por Reportos | | 1,441,518 | 917,275 | Acciones emitidas | | 9,900,000,000 | 9,900,000,000 |
| Garantías Recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC) | | 83,462 | 66,270 | Acciones en circulación posición propia | | 18,534,470 | 19,210,849 |
| Bancos divisas en moneda extranjera | | 53,649 | 114,350 | Acciones de Siefores posición de terceros | | 1 | 1 |
| Dólar Americano | | 53,646 | 114,350 | Acciones en circulación propiedad de los trabajadores | | 3,844,385,842 | 3,815,500,548 |
| Euros | | 3 | 1 | | | | |
| Compromisos futuros por la adquisición de Títulos Fiduciarios | | 4,834,900 | 3,106,295 | | | | |
| De Emisor Nacional | | 4,834,900 | 3,106,295 | | | | |
| Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición Larga | | 6,168,077 | 5,529,542 | | | | |
| Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera | | 4,741,477 | 4,429,542 | | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos | | 1,426,600 | 1,100,000 | | | | |
| Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición Corta | | 2,588,891 | 2,624,144 | | | | |
| Contratos Futuros sobre Dólar Americano | | 722,283 | 714,323 | | | | |
| Contratos Futuros sobre Euros | | 440,008 | 809,821 | | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos | | 1,426,600 | 1,100,000 | | | | |
| La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó: | | | | | | | |
| | Una plus(minus)valía de : | 541,778 | 1,459,240 | | | | |
| | Un valor de activos netos de: | 46,237,622 | 44,989,434 | | | | |
| | El precio de acción de : | 11.969603 | 11.732156 | | | | |

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 70-74 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 MARZO DE 2023 Y 2022

[Cifras en miles de pesos]

| Concepto | 2023 | 2022 |
|--|------------------|--------------------|
| Ingresos por la venta de valores | 4,384,402 | 5,555,507 |
| Intereses, dividendos, premios y derechos | 583,195 | 430,754 |
| Resultado cambiario otros productos | (82,522) | (79,900) |
| Resultados por Intermediación con Instrumentos Financieros Derivados | 336,893 | (188,737) |
| Ingresos Netos | 5,221,968 | 5,717,624 |
| Costo Venta de Valores | 3,996,239 | 5,171,808 |
| Gastos Generales | 1,566 | 3,013 |
| Comisiones sobre saldos | 64,628 | 61,867 |
| Egresos Netos | 4,062,433 | 5,236,688 |
| Utilidad de Operación | 1,159,535 | 480,936 |
| Otros resultados integrales | | |
| Plus(Minus)valías | 151,903 | (1,808,088) |
| UTILIDAD INTEGRAL EJERCICIO | 1,311,438 | (1,327,152) |

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.