

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

**SIEFORE SURA BASICA 60-64, S.A. DE C.V., SOCIEDAD DE INVERSIÓN ESPECIALIZADA DE FONDOS PARA EL RETIRO
SOCIEDAD DE INVERSIÓN BÁSICA**

ESTADO DE SITUACIÓN FINANCIERA AL 31 DE MARZO DE 2021 Y 2020

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO		2021	2020	PASIVO		2021	2020
DISPONIBLE				OBLIGACIONES			
Bancos moneda nacional		10	11	Acreedores		171,581	486,319
Bancos monedas extranjeras		84,314	83,001	Provisiones para gastos		11,699	2,981
Divisas por recibir		681,025	360,140	Divisas por entregar		312,758	383,629
		765,349	443,151	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)		6,491,063	10,044,559
RESERVADOS				TOTAL PASIVO		6,987,102	10,917,488
Bancos Moneda Extr., Depósitos reserv. al pago compromisos futuros en divisas		-	219,089				
		-	219,089				
INVERSIONES							
Inversión en valores de renta variable		9,053,775	8,258,693				
Plus (Minus) valia en valores de renta variable		1,016,855	(562,740)				
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís		16,950,328	20,158,826				
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís		3,586,042	2,063,025				
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos		26,537,243	21,496,916				
Plus (Minus) valia en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos		439,531	348,767				
Depósito Traspaso Banxico		-	214,282				
Plus (Minus) valia en inversión en el Depósito Traspaso Banxico		-	3,313				
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso		1,816,647	1,997,534				
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso		382,406	248,370				
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas		2,894,863	3,476,506				
Plus (Minus) valia instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas		390,388	119,924				
Inversión en FIBRAS		1,887,329	1,788,671				
Plus (Minus) valia en Inversión en FIBRAS		(281,948)	(571,808)				
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)		1	317				
Inversión en valores extranjeros de deuda		145,426	145,426				
Plus (Minus) valia en Inversión en valores extranjeros de deuda		12,790	6,432				
Inversión en títulos Fiduciarios		2,838,196	2,913,130				
Plus (minus) valia en Títulos Fiduciarios		199,849	346,514				
Valores Prestados		405,521	18,504				
Plus (Minus) valia de valores prestados		21,347	615				
Inversión en Fondos Mutuos		2,051,643	827,807				
Plus (Minus) valia de Fondos Mutuos		170,714	61,490				
		70,518,948	63,360,513				
DEUDORES DIVERSOS							
Liquidadora		146,585	14,299				
Dividendos o derechos por cobrar		17,145	29				
Intereses devengados sobre valores		761,273	724,825				
Reportos		2,638,215	3,939,639				
Premios por cobrar por préstamo de valores		26	3				
Intereses devengados sobre valores prestados		10,311	64				
Reembolsos y otros intereses		60	263				
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)		5,315,505	8,838,076				
		8,889,120	13,517,198				
TOTAL ACTIVO		80,173,417	77,539,952				
				TOTAL PASIVO MAS CAPITAL		80,173,417	77,539,952

CUENTAS DE ORDEN		2021	2020	CUENTAS DE ORDEN		2021	2020
Valores entregados en custodia		70,027,243	63,088,057	Capital social autorizado		27,500,100	27,500,100
Valores prestados		426,868	19,119	Acciones emitidas		27,500,100,000	27,500,100,000
Garantías recibidas por valores prestados		456,346	19,793	Acciones en circulación, posición propia		36,905,188	47,359,960
Colaterales recibidos por reportos		2,635,318	3,949,539	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores		5,843,920,528	6,290,809,616
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)		774,815	1,096,462				
Bancos divisas en moneda extranjera		59,713	59,048				
Dólares americanos		3,618	2,362				
Euros		-	592				
Yenes		56,095	56,093				
Divisas por recibir		33,318	15,335				
Dólares americanos		33,318	15,335				
Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en moneda extranjera		-	9,329				
Dólares americanos		-	9,329				
Divisas por entregar		15,301	16,335				
Dólares americanos		15,301	16,335				
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios		2,835,122	3,149,949				
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga		198,462,070	297,668,867				
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera		6,950,003	5,942,971				
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano		13,011,214	8,938,290				
Contratos Adelantados sobre Euros		3,505,332	1,195,857				
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas		1,018,712	53,062				
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional		-	132,804				
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos		39,303,092	93,989,792				
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano		49,507,807	41,680,432				
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS		4,892,944	2,477,493				
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros		337,691	3,537,339				
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos		31,345,525	98,506,903				
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano		48,529,268	37,798,073				
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros		-	3,355,369				
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional		60,483	60,483				
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta		192,558,557	291,930,667				
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera		799,517	342,197				
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano		13,391,385	8,982,233				
Contratos Adelantados sobre Euros		2,815,163	778,343				
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas		1,252,957	98,181				
Contratos Futuros sobre Dólar Americano		315,603	320,253				
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos		27,084,134	94,718,474				
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano		50,065,961	39,334,766				
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS		3,212,648	3,212,648				
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros		518,978	3,874,347				
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos		41,851,041	94,122,073				
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano		50,913,481	42,609,813				
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros		337,691	3,537,339				

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$	5,937,974	\$	2,063,901
Un valor de los activos netos de:	\$	73,186,315	\$	66,622,464
El precio de la acción de:	\$	12.444905	\$	10.511310

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 60-64, 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 31 DE MARZO DE 2021 Y 2020

(Cifras en miles de pesos)

	2021	2020
Ingresos por la venta de Valores	5,462,571	8,553,735
Intereses, dividendos, premios y derechos	881,687	900,029
Resultado cambiario / Otros productos	(5,122)	(46,059)
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	389,686	(2,370,313)
INGRESOS NETOS	6,728,822	7,037,392
Costo de ventas de valores	4,807,677	8,352,197
Gastos generales	7,083	9,176
Comisiones sobre saldos	154,422	156,689
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	3,245	758
EGRESOS NETOS	4,972,426	8,518,820
UTILIDAD DE OPERACIÓN	1,756,395	(1,481,428)
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(1,952,419)	(1,650,560)
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	(196,024)	(3,131,987)

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.

En la Sesión del Consejo de Administración con fecha 28 de enero de 2021 fueron aprobados los Estados Financieros al 31 de diciembre de 2020, asimismo los presentes Estados Financieros al 31 de marzo del 2021 serán aprobados en la Sesión del Consejo de Administración con fecha 5 de mayo de 2021