

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 31 DE MARZO DE 2021 Y 2020

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2021	2020	PASIVO	2021	2020
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	10	10	Acreedores	547,710	465,838
Bancos monedas extranjeras	51,184	84,880	Provisiones para gastos	22,544	4,909
Divisas por recibir	810,916	790,713	Divisas por entregar	819,120	808,388
	862,111	875,603	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	7,020,014	11,674,885
INVERSIONES			TOTAL PASIVO	8,409,388	12,954,020
Inversión en valores de renta variable	21,243,271	15,146,428			
Plus (Minus) valia en valores de renta variable	2,090,066	(1,127,601)			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	24,305,299	30,271,032			
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	4,573,161	3,085,207			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	40,242,338	30,553,704			
Plus (Minus) valia en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	558,700	519,440			
Depósito Traspaso Banxico	4,431	2,689			
Plus (Minus) valia en inversión en el Depósito Traspaso Banxico	102	42			
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	2,986,019	2,791,280	CAPITAL		
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	509,979	262,813	CAPITAL CONTRIBUIDO	30,142,818	25,466,479
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	2,548,011	5,022,292	Capital social pagado	48,552,140	46,666,803
Plus (Minus) valia instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	271,198	175,957	Prima en venta de acciones	(18,409,322)	(21,200,324)
Inversión en FIBRAS	3,676,125	3,562,524	CAPITAL GANADO	88,891,748	71,881,078
Plus (Minus) valia en Inversion en FIBRAS	(573,750)	(1,137,845)	Resultados de ejercicios anteriores	85,500,172	75,690,810
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	6,578	-	Resultados del ejercicio	3,391,577	(3,809,733)
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	2	738	OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
Inversión en valores extranjeros de deuda	231,512	231,512	PLUS (MINUS) VALÍAS	8,361,530	2,751,203
Plus (Minus) valia en Inversión en valores extranjeros de deuda	14,537	5,290			
Inversión en títulos Fiduciarios	9,022,942	7,140,995	TOTAL CAPITAL CONTABLE	127,396,096	100,098,760
Plus (minus) valia en Títulos Fiduciarios	423,544	826,907			
Valores Prestados	806,249	441,690			
Plus (Minus) valia de valores prestados	42,151	16,791			
Inversión en Fondos Mutuos	5,788,984	1,672,084			
Plus (Minus) valia de Fondos Mutuos	451,840	124,204			
	119,223,293	99,588,172			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	149,149	26,118			
Dividendos o derechos por cobrar	27,051	66			
Intereses devengados sobre valores	1,046,723	1,025,626			
Reportos	7,995,871	2,530,476			
Premios por cobrar por préstamo de valores	32	44			
Intereses devengados sobre valores prestados	20,493	2,122			
Reembolsos y otros intereses	866	530			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	6,479,895	9,004,023			
	15,720,080	12,589,005			
TOTAL ACTIVO	135,805,484	113,052,780	TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	135,805,484	113,052,780

CUENTAS DE ORDEN	2021	2020	CUENTAS DE ORDEN	2021	2020
Valores entregados en custodia	118,079,487	98,932,754	Capital social autorizado	126,259,200	126,259,200
Valores prestados	848,400	458,481	Acciones emitidas	25,000,019,801	25,000,019,801
Garantías recibidas por valores prestados	909,073	472,303	Acciones en circulación, posición propia	59,672,590	67,166,855
Colaterales recibidos por reportos	8,001,936	2,535,503	Acciones de Siefores, posición de terceros	2	2
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	937,509	981,751	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	9,553,919,678	9,173,118,218
Bancos divisas en moneda extranjera	55,265	56,280			
Dólares americanos	2,023	2,237			
Euros	-	802			
Yenes	53,242	53,241			
Divisas por recibir	39,673	33,669			
Dólares americanos	39,673	33,669			
Divisas por entregar	40,074	34,422			
Dólares americanos	40,074	34,422			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	9,021,353	6,384,438			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	223,435,786	298,065,700			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	21,940,069	13,881,752			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	20,226,813	13,544,421			
Contratos Adelantados sobre Euros	6,002,647	1,943,340			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	2,220,367	90,274			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	-	560,728			
Contratos de Opciones sobre Renta Variable Nacional	2,803	2,803			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	42,444,150	90,558,161			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	42,030,453	37,159,513			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	5,938,946	2,923,686			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	249,598	3,023,005			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	40,800,275	98,326,410			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	41,438,994	32,871,295			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	-	3,039,640			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	140,672	140,672			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	207,990,565	288,230,819			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	2,191,984	707,328			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	24,162,129	17,303,133			
Contratos Adelantados sobre Euros	5,244,634	1,472,442			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	2,859,708	167,036			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	330,671	382,238			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	35,819,434	93,734,415			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	43,613,254	34,909,048			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	4,030,361	4,030,361			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	458,911	3,498,551			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	45,670,257	90,905,484			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	43,359,623	38,097,779			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	249,598	3,023,005			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$	8,361,530	\$	2,751,203
Un valor de los activos netos de:	\$	127,396,096	\$	100,098,760
El precio de la acción de:	\$	13.251664	\$	10.832865

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 31 DE MARZO DE 2021 Y 2020

(Cifras en miles de pesos)

	2021	2020
Ingresos por la venta de Valores	12,960,670	13,413,742
Intereses, dividendos, premios y derechos	1,323,588	1,309,480
Resultado cambiario / Otros productos	(11,763)	(76,008)
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	790,248	(5,128,225)
INGRESOS NETOS	15,062,742	9,518,989
Costo de ventas de valores	11,388,167	13,075,672
Gastos generales	10,754	14,446
Comisiones sobre saldos	264,492	237,074
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	7,753	1,531
EGRESOS NETOS	11,671,166	13,328,722
UTILIDAD DE OPERACIÓN	3,391,577	(3,809,733)
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(3,033,472)	(3,090,311)
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	358,105	(6,900,043)

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