

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

**SIFORE SURA BASICA 80-84, 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	501,677	400,933
Bancos monedas extranjeras	125,724	48,168	Provisiones para gastos	20,338	4,212
Divisas por recibir	850,560	807,223	Divisas por entregar	950,415	812,102
	976,294	855,402	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	2,647,666	4,371,260
RESERVADOS			TOTAL PASIVO	4,120,096	5,588,507
Bancos Moneda Nal., Depósitos reserv. al pago compromisos futuros en pesos	11,133	-			
	11,133	-			
INVERSIONES			CAPITAL CONTABLE	2021	2020
Inversión en valores de renta variable	20,647,981	14,466,199	CAPITAL		
Plus (Minus) valia en valores de renta variable	1,960,620	(1,086,054)	CAPITAL CONTRIBUIDO	90,408,213	83,633,845
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	19,080,709	23,131,525	Capital social pagado	94,839,027	88,545,680
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	3,228,098	1,964,012	Prima en venta de acciones	(4,430,814)	(4,911,835)
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	33,468,785	26,528,732	CAPITAL GANADO	11,649,679	(4,055,090)
Plus (Minus) valia en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	547,478	517,096	Resultados de ejercicios anteriores	8,077,210	458,674
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	2,513,288	2,284,655	Resultados del ejercicio	3,572,470	(4,513,764)
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	341,675	110,766	OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	1,066,629	3,175,694	PLUS (MINUS) VALÍAS	6,670,224	1,351,451
Plus (Minus) valia instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	95,454	75,391			
Inversión en FIBRAS	3,003,576	2,905,895	TOTAL CAPITAL CONTABLE	108,728,116	80,930,206
Plus (Minus) valia en Inversion en FIBRAS	(426,272)	(897,629)			
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	2	721			
Inversión en valores extranjeros de deuda	127,188	127,188			
Plus (Minus) valia en Inversión en valores extranjeros de deuda	8,766	3,576			
Inversión en títulos Fiduciarios	7,399,042	5,448,436			
Plus (minus) valia en Títulos Fiduciarios	496,499	538,792			
Valores Prestados	426,619	166,788			
Plus (Minus) valia de valores prestados	4,272	6,528			
Inversión en Fondos Mutuos	5,911,681	1,703,951			
Plus (Minus) valia de Fondos Mutuos	413,634	118,973			
	100,315,726	81,291,234			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	183,451	25,717			
Dividendos o derechos por cobrar	18,199	72			
Intereses devengados sobre valores	841,378	797,293			
Reportos	6,515,409	1,530,538			
Premios por cobrar por préstamo de valores	16	8			
Intereses devengados sobre valores prestados	10,480	2,197			
Reembolsos y otros intereses	976	538			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	3,975,151	2,015,714			
	11,545,060	4,372,078			
TOTAL ACTIVO	112,848,213	86,518,713	TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	112,848,213	86,518,713

CUENTAS DE ORDEN		2021	2020	CUENTAS DE ORDEN		2021	2020
Valores entregados en custodia		99,618,033	80,669,997	Capital social autorizado		35,000,100	35,000,100
Valores prestados		430,890	173,316	Acciones emitidas		35,000,100,000	35,000,100,000
Garantías recibidas por valores prestados		455,712	180,505	Acciones en circulación, posición propia		58,862,945	63,751,240
Colaterales recibidos por reportos		6,520,433	1,533,813	Acciones de Siefos, posición de terceros		1	1
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)		2,074,420	193,764	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores		9,425,039,751	8,790,816,743
Bancos divisas en moneda extranjera		6,151	1,996				
Dólares americanos		6,151	1,453				
Euros		-	544				
Divisas por recibir		41,613	34,372				
Dólares americanos		41,613	34,372				
Divisas por entregar		46,498	34,580				
Dólares americanos		46,498	34,580				
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios		8,031,219	5,440,070				
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga		103,026,059	47,656,349				
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera		24,052,711	14,361,079				
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano		19,553,295	5,094,646				
Contratos Adelantados sobre Euros		5,745,902	1,810,428				
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas		2,362,691	89,197				
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional		468,853	1,077,188				
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos		13,549,186	2,506,731				
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano		8,668,171	5,928,244				
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS		2,140,925	883,393				
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros		161,504	797,340				
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos		13,577,050	7,261,913				
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano		12,608,376	6,951,201				
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros		-	757,595				
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional		137,394	137,394				
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta		87,847,989	40,257,964				
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera		2,151,732	715,714				
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano		26,731,708	12,566,957				
Contratos Adelantados sobre Euros		5,153,887	1,448,030				
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas		2,826,681	165,042				
Contratos Futuros sobre Dólar Americano		40,723	39,733				
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos		12,365,900	6,411,300				
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano		14,040,458	8,274,473				
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS		1,416,521	1,416,521				
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros		384,415	1,142,010				
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos		13,543,737	1,352,602				
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano		9,030,723	5,928,244				
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros		161,504	797,340				

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$	6,670,224	\$	1,351,451
Un valor de los activos netos de:	\$	108,728,116	\$	80,930,206
El precio de la acción de:	\$	11.464491	\$	9.139938

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 80-84, 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	14,023,696	13,218,066
Intereses, dividendos, premios y derechos	1,073,598	1,044,003
Resultado cambiario / Otros productos	3,586	(80,639)
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	1,107,016	(5,503,394)
INGRESOS NETOS	16,207,895	8,678,036
Costo de ventas de valores	12,394,535	12,986,664
Gastos generales	9,412	10,599
Comisiones sobre saldos	223,828	192,983
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	7,651	1,554
EGRESOS NETOS	12,635,426	13,191,800
UTILIDAD DE OPERACIÓN	3,572,470	(4,513,764)
OTROS RESULTADOS INTEGRALES PLUS (MINUS) VALÍAS	(2,648,534)	(2,669,551)
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	923,936	(7,183,315)

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