

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

**SIFORE SURA BASICA 90-94, 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	207,555	275,685
Bancos monedas extranjeras	133,603	24,470	Provisiones para gastos	7,441	1,304
Divisas por recibir	363,371	260,761	Divisas por entregar	472,486	254,066
	496,985	285,241	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	1,059,099	1,369,856
RESERVADOS			TOTAL PASIVO	1,746,581	1,900,911
Bancos Moneda Nal., Depósitos reserv. al pago compromisos futuros en pesos	8,233	-			
Bancos Moneda Extr., Depósitos reserv. al pago compromisos futuros en divisas	-	147,591			
	8,233	147,591			
INVERSIONES			CAPITAL CONTABLE	2021	2020
Inversión en valores de renta variable	7,905,422	4,467,308	CAPITAL		
Plus (Minus) valia en valores de renta variable	733,389	(340,970)	CAPITAL CONTRIBUIDO	34,076,097	26,349,275
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	5,712,071	6,880,567	Capital social pagado	34,885,563	27,819,261
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	784,178	551,304	Prima en venta de acciones	(809,467)	(1,469,986)
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	14,457,441	8,373,194	CAPITAL GANADO	4,263,062	(1,293,942)
Plus (Minus) valia en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	83,126	164,172	Resultados de ejercicios anteriores	2,800,827	122,675
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	778,791	721,366	Resultados del ejercicio	1,462,236	(1,416,618)
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	91,693	22,844	OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	370,727	1,029,943	PLUS (MINUS) VALÍAS	1,902,005	351,920
Plus (Minus) valia instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	31,615	22,999			
Inversión en FIBRAS	926,560	867,750	TOTAL CAPITAL CONTABLE	40,241,164	25,407,252
Plus (Minus) valia en Inversion en FIBRAS	(114,831)	(258,729)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	8	10,268			
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	1	213			
Inversión en valores extranjeros de deuda	34,621	34,621			
Plus (Minus) valia en Inversión en valores extranjeros de deuda	3,107	1,599			
Inversión en títulos Fiduciarios	2,334,624	1,566,218			
Plus (minus) valia en Títulos Fiduciarios	160,238	142,234			
Valores Prestados	-	313,595			
Plus (Minus) valia de valores prestados	-	10,489			
Inversión en Fondos Mutuos	2,281,314	515,267			
Plus (Minus) valia de Fondos Mutuos	129,491	35,977			
	36,703,584	25,132,231			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	47,573	8,520			
Dividendos o derechos por cobrar	5,065	21			
Intereses devengados sobre valores	302,709	243,905			
Reportos	2,897,258	898,773			
Premios por cobrar por préstamo de valores	-	15			
Intereses devengados sobre valores prestados	0	5,640			
Reembolsos y otros intereses	507	163			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	1,525,831	586,063			
	4,778,942	1,743,101			
TOTAL ACTIVO	41,987,744	27,308,164	TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	41,987,744	27,308,164

CUENTAS DE ORDEN		2021	2020	CUENTAS DE ORDEN		2021	2020
Valores entregados en custodia		36,565,975	24,579,465	Capital social autorizado		35,000,100	35,000,100
Valores prestados		-	324,085	Acciones emitidas		35,000,100,000	35,000,100,000
Garantías recibidas por valores prestados		-	340,862	Acciones en circulación, posición propia		17,652,503	16,196,884
Colaterales recibidos por reportos		2,895,268	900,696	Acciones de Siefos, posición de terceros		1	1
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)		773,350	48,426	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores		2,803,318,045	2,233,367,352
Bancos divisas en moneda extranjera		6,536	974				
Dólares americanos		6,536	298				
Euros		-	676				
Divisas por recibir		17,777	11,103				
Dólares americanos		17,777	11,103				
Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en moneda extranjera		-	6,285				
Dólares americanos		-	6,285				
Divisas por entregar		23,116	10,818				
Dólares americanos		23,116	10,818				
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios		2,713,984	1,641,375				
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga		40,485,655	17,535,918				
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera		9,742,632	4,470,848				
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano		7,868,353	1,249,920				
Contratos Adelantados sobre Euros		2,131,248	548,439				
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas		976,825	28,626				
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional		108,824	334,223				
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos		6,781,649	2,977,310				
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano		2,946,349	2,104,070				
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS		542,819	398,693				
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros		48,941	1,278				
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos		5,033,125	3,094,950				
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano		4,264,208	2,286,880				
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional		40,682	40,682				
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta		33,663,298	15,184,369				
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera		850,573	221,435				
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano		10,176,239	3,513,051				
Contratos Adelantados sobre Euros		1,839,135	375,653				
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas		1,021,568	52,966				
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos		4,423,550	2,605,650				
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano		4,764,907	2,749,989				
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS		702,414	702,414				
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros		141,493	141,493				
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos		6,627,214	2,716,370				
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano		3,067,265	2,104,070				
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros		48,941	1,278				

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$	1,902,005	\$	351,920
Un valor de los activos netos de:	\$	40,241,164	\$	25,407,252
El precio de la acción de:	\$	14.265007	\$	11.294300

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 90-94, 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	5,899,782	3,528,472
Intereses, dividendos, premios y derechos	375,842	330,069
Resultado cambiario / Otros productos	744	(19,939)
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	436,866	(1,716,620)
INGRESOS NETOS	6,713,233	2,121,982
Costo de ventas de valores	5,163,650	3,475,885
Gastos generales	3,771	3,003
Comisiones sobre saldos	80,860	59,242
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	2,716	470
EGRESOS NETOS	5,250,997	3,538,599
UTILIDAD DE OPERACIÓN	1,462,236	(1,416,618)
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(1,120,818)	(790,447)
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	341,417	(2,207,064)

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