

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

**SIEFORE SURA BASICA 55-59, 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	14,907	32,563
Bancos monedas extranjeras	26,957	12,580	Provisiones para gastos	2,561	713
Divisas por recibir	98,575	39,659	Divisas por entregar	18,154	40,175
	125,542	52,249	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	1,388,572	1,510,260
INVERSIONES			TOTAL PASIVO	1,424,193	1,583,711
Inversión en valores de renta variable	616,983	1,125,591			
Plus (Minus) valia en valores de renta variable	64,569	(56,505)			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	6,969,730	9,324,466			
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	1,727,404	1,206,251			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	7,663,154	7,788,830			
Plus (Minus) valia en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	222,241	205,389			
Depósito Traspaso Banxico	7,293	4,936			
Plus (Minus) valia en inversión en el Depósito Traspaso Banxico	169	76			
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	345,432	494,808			
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	84,199	49,981			
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	869,546	745,900			
Plus (Minus) valia instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	107,437	22,277			
Inversión en FIBRAS	592,478	577,003			
Plus (Minus) valia en Inversión en FIBRAS	(100,257)	(197,717)			
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	0	25			
Inversión en valores extranjeros de deuda	141,591	141,591			
Plus (Minus) valia en Inversión en valores extranjeros de deuda	28,995	20,751			
Inversión en Fondos Mutuos	144,555	96,368			
Plus (Minus) valia de Fondos Mutuos	14,000	6,729			
	19,499,517	21,556,748			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	36,320	3,208			
Dividendos o derechos por cobrar	94	2			
Intereses devengados sobre valores	242,981	254,359			
Reportos	331,360	401,325			
Reembolsos y otros intereses	891	30			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	1,043,323	1,262,996			
	1,654,969	1,921,921			
TOTAL ACTIVO	21,280,028	23,530,919			
			CAPITAL CONTABLE	2021	2020
			CAPITAL		
			CAPITAL CONTRIBUIDO	4,146,422	8,983,010
			Capital social pagado	6,210,546	7,751,511
			Prima en venta de acciones	(2,064,124)	1,231,499
			CAPITAL GANADO	13,560,656	11,706,965
			Resultados de ejercicios anteriores	13,096,011	11,560,947
			Resultados del ejercicio	464,645	146,018
			OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
			PLUS (MINUS) VALÍAS	2,148,756	1,257,232
			TOTAL CAPITAL CONTABLE	19,855,835	21,947,207
			TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	21,280,028	23,530,919

CUENTAS DE ORDEN	2021	2020	CUENTAS DE ORDEN	2021	2020
Valores entregados en custodia	19,263,717	21,235,124	Capital social autorizado	11,354,689	11,354,689
Colaterales recibidos por reportos	330,996	401,913	Acciones emitidas	3,200,028,183	3,200,028,183
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	367,481	246,228	Acciones en circulación, posición propia	11,712,052	19,735,566
Bancos divisas en moneda extranjera	6,397	5,592	Acciones de Siefos, posición de terceros	1,127	1,127
Dólares americanos	1,273	280	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	1,738,570,122	2,164,828,188
Euros	-	189			
Yenes	5,125	5,123			
Divisas por recibir	4,823	1,689			
Dólares americanos	4,823	1,689			
Divisas por entregar	888	1,711			
Dólares americanos	888	1,711			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	31,402,675	34,567,296			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	721,681	503,580			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	3,213,386	1,802,567			
Contratos Adelantados sobre Euros	809,890	227,143			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	129,347	11,600			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	-	20,658			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	203,615	206,615			
Contratos de Opciones sobre Renta Variable Nacional	52	52			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	8,221,827	9,493,927			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	4,334,206	3,890,396			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	1,284,790	957,346			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	36,706	307,722			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	7,926,632	13,243,698			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	4,515,822	3,608,346			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	-	288,924			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	4,722	4,722			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	30,032,267	33,337,760			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	91,183	21,652			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	2,779,993	1,420,828			
Contratos Adelantados sobre Euros	660,450	51,109			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	147,996	21,463			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	6,845,077	12,220,361			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	4,884,829	3,977,353			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	1,052,913	1,052,913			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	87,168	376,092			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	8,983,389	9,928,019			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	4,462,561	3,960,247			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	36,706	307,722			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó

Una plus (minus) valía de:	\$ 2,148,756	\$ 1,257,232
Un valor de los activos netos de:	\$ 19,855,835	\$ 21,947,207
El precio de la acción de:	\$ 11.344355	\$ 10.046489

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 55-59, 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	1,641,149	3,479,448
Intereses, dividendos, premios y derechos	257,141	276,902
Resultado cambiario / Otros productos	127	(10,214)
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	25,892	(216,507)
INGRESOS NETOS	1,924,310	3,529,629
Costo de ventas de valores	1,414,988	3,329,836
Gastos generales	1,145	1,544
Comisiones sobre saldos	43,248	52,142
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	283	88
EGRESOS NETOS	1,459,665	3,383,611
UTILIDAD DE OPERACIÓN	464,645	146,018
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(812,043)	(442,340)
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	(347,398)	(296,322)

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