

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 2022 Y 2021

(Cifras en miles de pesos)

| ACTIVO | 2022 | 2021 | PASIVO | 2022 | 2021 |
|---|--------------------|--------------------|---|---------------------|---------------------|
| DISPONIBLE | | | OBLIGACIONES | | |
| Bancos moneda nacional | 10 | 10 | Acreedores | 497,460 | 547,710 |
| Bancos monedas extranjeras | 681,305 | 51,184 | Provisiones para gastos | 9,694 | 22,544 |
| Divisas por recibir | 469,179 | 810,916 | Divisas por entregar | 744,771 | 819,120 |
| | 1,150,493 | 862,111 | Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC) | 5,576,802 | 7,020,014 |
| INVERSIONES | | | TOTAL PASIVO | 6,828,728 | 8,409,388 |
| Inversión en valores de renta variable | 25,566,239 | 21,243,271 | | | |
| Plus (Minus) valía en valores de renta variable | 1,654,664 | 2,090,066 | | | |
| Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis | 37,064,547 | 24,305,299 | | | |
| Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis | 4,056,594 | 4,573,161 | | | |
| Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos | 43,859,699 | 40,242,338 | | | |
| Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos | (2,706,937) | 558,700 | | | |
| Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso | 2,644,618 | 2,986,019 | | | |
| Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso | 159,145 | 509,979 | | | |
| Inversión en Depósito Banxico | 4,894 | 4,431 | | | |
| Plus (Minus) valía en Depósito Banxico | 94 | 102 | | | |
| Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas | 2,306,200 | 2,548,011 | | | |
| Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas | (40,628) | 271,198 | | | |
| Inversión en FIBRAS | 3,874,611 | 3,676,125 | | | |
| Plus (Minus) valía en Inversión en FIBRAS | (636,529) | (573,750) | | | |
| Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados | 6,384 | 6,578 | | | |
| Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC) | 8,630 | 2 | | | |
| Inversión en valores extranjeros de deuda | 540,202 | 231,512 | | | |
| Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda | (10,767) | 14,537 | | | |
| Inversión en títulos Fiduciarios | 12,312,954 | 9,022,942 | | | |
| Plus (minus) valía en Títulos Fiduciarios | 743,171 | 423,544 | | | |
| Valores Prestados | 398,189 | 806,249 | | | |
| Plus (Minus) valía de valores prestados | (2,206) | 42,151 | | | |
| Inversión en Fondos Mutuos | 5,779,354 | 5,788,984 | | | |
| Plus (Minus) valía de Fondos Mutuos | (71,121) | 451,840 | | | |
| | 137,512,001 | 119,223,293 | | | |
| DEUDORES DIVERSOS | | | | | |
| Liquidadora | 1,169,607 | 149,149 | | | |
| Dividendos o derechos por cobrar | 66 | 27,051 | | | |
| Intereses devengados sobre valores | 1,288,760 | 1,046,723 | | | |
| Reportos | 3,349,630 | 7,995,871 | | | |
| Premios por cobrar por préstamo de valores | 8 | 32 | | | |
| Intereses devengados sobre valores prestados | 5,215 | 20,493 | | | |
| Reembolsos y otros intereses | 3,118 | 866 | | | |
| Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC) | 4,195,836 | 6,479,895 | | | |
| | 10,012,241 | 15,720,080 | | | |
| TOTAL ACTIVO | 148,674,735 | 135,805,484 | | | |
| | | | CAPITAL CONTABLE | 2022 | 2021 |
| | | | CAPITAL | | |
| | | | CAPITAL CONTRIBUIDO | 38,448,320 | 30,142,818 |
| | | | Capital social pagado | 51,597,670 | 48,552,140 |
| | | | Prima en venta de acciones | (13,149,349) | (18,409,322) |
| | | | CAPITAL GANADO | 100,252,208 | 88,891,748 |
| | | | Resultados de ejercicios anteriores | 98,266,176 | 85,500,172 |
| | | | Resultados del ejercicio | 1,986,032 | 3,391,577 |
| | | | OTROS RESULTADOS INTEGRALES | | |
| | | | PLUS (MINUS) VALÍAS | 3,145,479 | 8,361,530 |
| | | | TOTAL CAPITAL CONTABLE | 141,846,008 | 127,396,096 |
| | | | TOTAL PASIVO MAS CAPITAL | 148,674,735 | 135,805,484 |

| CUENTAS DE ORDEN | 2022 | 2021 | CUENTAS DE ORDEN | 2022 | 2021 |
|---|-------------|-------------|---|----------------|----------------|
| Valores entregados en custodia | 136,488,979 | 118,079,487 | Capital social autorizado | 126,259,200 | 126,259,200 |
| Valores prestados | 395,983 | 848,400 | Acciones emitidas | 25,000,019,801 | 25,000,019,801 |
| Garantías recibidas por valores prestados | 417,547 | 909,073 | Acciones en circulación, posición propia | 57,009,847 | 59,672,590 |
| Colaterales recibidos por reportos | 3,350,336 | 8,001,936 | Acciones de Siefores, posición de terceros | 2 | 2 |
| Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC) | 728,243 | 937,509 | Acciones en circulación propiedad de los trabajadores | 10,159,614,132 | 9,553,919,678 |
| Bancos divisas en moneda extranjera | 34,303 | 55,265 | | | |
| Dólares americanos | 33,867 | 2,023 | | | |
| Yenes | - | 53,242 | | | |
| Otras Divisas | 436 | - | | | |
| Divisas por recibir | 23,564 | 39,673 | | | |
| Dólares americanos | 23,564 | 39,673 | | | |
| Divisas por entregar | 37,405 | 40,074 | | | |
| Dólares americanos | 37,405 | 40,074 | | | |
| Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios | 7,122,246 | 9,021,353 | | | |
| Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga | 182,729,380 | 223,435,786 | | | |
| Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera | 27,793,652 | 21,940,069 | | | |
| Contratos Adelantados sobre Dólar Americano | 13,579,647 | 20,226,813 | | | |
| Contratos Adelantados sobre Euros | 1,279,812 | 6,002,647 | | | |
| Contratos Adelantados sobre Otras Divisas | 592,941 | 2,220,367 | | | |
| Contratos de Opciones sobre Renta Variable Nacional | - | 2,803 | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos | 48,389,721 | 42,444,150 | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano | 26,539,932 | 42,030,453 | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS | 5,297,405 | 5,938,946 | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros | 249,598 | 249,598 | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos | 36,455,011 | 40,800,275 | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano | 22,549,953 | 41,438,994 | | | |
| Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional | 1,708 | 140,672 | | | |
| Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta | 159,499,424 | 207,990,565 | | | |
| Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera | 4,626,046 | 2,191,984 | | | |
| Contratos Adelantados sobre Dólar Americano | 12,458,039 | 24,162,129 | | | |
| Contratos Adelantados sobre Euros | 1,602,086 | 5,244,634 | | | |
| Contratos Adelantados sobre Otras Divisas | 1,032,742 | 2,859,708 | | | |
| Contratos Futuros sobre Dólar Americano | - | 330,671 | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos | 32,320,234 | 35,819,434 | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano | 24,660,948 | 43,613,254 | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS | 3,184,497 | 4,030,361 | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros | 458,911 | 458,911 | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos | 51,037,221 | 45,670,257 | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano | 27,869,103 | 43,359,623 | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros | 249,598 | 249,598 | | | |

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

| | | |
|-----------------------------------|----------------|----------------|
| Una plus (minus) valía de: | \$ 3,145,479 | \$ 8,361,530 |
| Un valor de los activos netos de: | \$ 141,846,008 | \$ 127,396,096 |
| El precio de la acción de: | \$ 13.883843 | \$ 13.251664 |

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 2022 Y 2021

(Cifras en miles de pesos)

| | 2022 | 2021 |
|--|--------------------|-------------------|
| Ingresos por la venta de Valores | 13,641,687 | 12,960,670 |
| Intereses, dividendos, premios y derechos | 2,117,248 | 1,323,588 |
| Resultado cambiario / Otros productos | (51,026) | (11,763) |
| Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados | (541,997) | 790,248 |
| INGRESOS NETOS | 15,165,912 | 15,062,742 |
| Costo de ventas de valores | 12,972,739 | 11,388,167 |
| Gastos generales | 8,132 | 10,754 |
| Comisiones sobre saldos | 191,509 | 264,492 |
| Comisiones por gestión de Fondos Mutuos | 7,500 | 7,753 |
| EGRESOS NETOS | 13,179,880 | 11,671,166 |
| UTILIDAD DE OPERACIÓN | 1,986,032 | 3,391,577 |
| OTROS RESULTADOS INTEGRALES | | |
| PLUS (MINUS) VALÍAS | (4,701,427) | (3,033,472) |
| UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO | (2,715,395) | 358,105 |

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 24 de Enero de 2022 fueron aprobados los Estados Financieros del 31 de Diciembre de 2021, asimismo los presentes Estados Financieros al 31 de Marzo de 2022 serán aprobados en la Sesión del Consejo de Administración con fecha 18 de Abril de 2022