

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**

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	288,975	501,677
Bancos monedas extranjeras	604,457	125,724	Provisiones para gastos	9,526	20,338
Divisas por recibir	454,815	850,560	Divisas por entregar	757,759	950,415
	1,059,283	976,294	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	2,817,980	2,647,666
RESERVADOS					
Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en pesos	-	11,133			
	-	11,133			
INVERSIONES					
Inversión en valores de renta variable	23,396,751	20,647,981			
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	1,472,534	1,960,620	TOTAL PASIVO	3,874,240	4,120,096
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	29,158,084	19,080,709			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	2,716,603	3,228,098			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	41,411,026	33,468,785			
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(2,436,487)	547,478			
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	2,245,134	2,513,288			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	61,075	341,675			
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	1,685,446	1,066,629	CAPITAL CONTABLE	2022	2021
Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	(42,783)	95,454	CAPITAL		
Inversión en FIBRAS	3,195,974	3,003,576	CAPITAL CONTRIBUIDO	100,434,572	90,408,213
Plus (Minus) valía en Inversión en FIBRAS	(471,986)	(426,272)	Capital social pagado	103,212,754	94,839,027
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	36,815	-	Prima en venta de acciones	(2,778,182)	(4,430,814)
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	8,429	2			
Inversión en valores extranjeros de deuda	455,809	127,188	CAPITAL GANADO	22,065,908	11,649,679
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	(6,356)	8,766	Resultados de ejercicios anteriores	20,771,764	8,077,210
Inversión en títulos Fiduciarios	10,671,068	7,399,042	Resultados del ejercicio	1,294,144	3,572,470
Plus (minus) valía en Títulos Fiduciarios	841,635	496,499			
Valores Prestados	450,135	426,619	OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
Plus (Minus) valía de valores prestados	(29,471)	4,272	PLUS (MINUS) VALÍAS	2,007,323	6,670,224
Inversión en Fondos Mutuos	5,908,844	5,911,681			
Plus (Minus) valía de Fondos Mutuos	(97,442)	413,634	TOTAL CAPITAL CONTABLE	124,507,803	108,728,116
	120,630,836	100,315,726			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	903,414	183,451			
Dividendos o derechos por cobrar	73	18,199			
Intereses devengados sobre valores	1,079,669	841,378			
Reportos	2,932,252	6,515,409			
Premios por cobrar por préstamo de valores	6	16			
Intereses devengados sobre valores prestados	3,666	10,480			
Reembolsos y otros intereses	1,870	976			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	1,770,974	3,975,151			
	6,691,925	11,545,060			
TOTAL ACTIVO	128,382,044	112,848,213	TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	128,382,044	112,848,213

CUENTAS DE ORDEN	2022	2021	CUENTAS DE ORDEN	2022	2021
Valores entregados en custodia	119,845,729	99,618,033	Capital social autorizado	35,000,100	35,000,100
Valores prestados	420,664	430,890	Acciones emitidas	35,000,100,000	35,000,100,000
Garantías recibidas por valores prestados	439,873	455,712	Acciones en circulación, posición propia	57,982,827	58,862,945
Colaterales recibidos por reportos	2,932,871	6,520,433	Acciones de Siefores, posición de terceros	1	1
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	442,701	2,074,420	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	10,263,292,563	9,425,039,751
Bancos divisas en moneda extranjera	30,437	6,151			
Dólares americanos	30,035	6,151			
Otras Divisas	401	-			
Divisas por recibir	22,842	41,613			
Dólares americanos	22,842	41,613			
Divisas por entregar	38,057	46,498			
Dólares americanos	38,057	46,498			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	6,206,560	8,031,219			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	94,678,186	103,026,059			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	33,015,088	24,052,711			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	12,230,415	19,553,295			
Contratos Adelantados sobre Euros	1,281,444	5,745,902			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	906,269	2,362,691			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	219,349	468,853			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	21,753,622	13,549,186			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	5,949,038	8,668,171			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	1,885,839	2,140,925			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	161,504	161,504			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	12,678,350	13,577,050			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	4,595,599	12,608,376			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	1,668	137,394			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	65,433,350	87,847,989			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	5,844,884	2,151,732			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	10,625,444	26,731,708			
Contratos Adelantados sobre Euros	1,664,409	5,153,887			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	-	2,826,681			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	-	40,723			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	11,467,200	12,365,900			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	6,027,681	14,040,458			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	1,416,521	1,416,521			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	310,177	384,415			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	21,603,938	13,543,737			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	6,311,590	9,030,723			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	161,504	161,504			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$ 2,007,323	\$ 6,670,224
Un valor de los activos netos de:	\$ 124,507,803	\$ 108,728,116
El precio de la acción de:	\$ 12.063219	\$ 11.464491

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 2022 Y 2021

(Cifras en miles de pesos)

	2022	2021
Ingresos por la venta de Valores	9,188,743	14,023,696
Intereses, dividendos, premios y derechos	1,839,664	1,073,598
Resultado cambiario / Otros productos	(51,756)	3,586
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	(885,246)	1,107,016
INGRESOS NETOS	10,091,405	16,207,895
Costo de ventas de valores	8,615,191	12,394,535
Gastos generales	6,712	9,412
Comisiones sobre saldos	167,736	223,828
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	7,622	7,651
EGRESOS NETOS	8,797,262	12,635,426
UTILIDAD DE OPERACIÓN	1,294,144	3,572,470
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(4,127,937)	(2,648,534)
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	(2,833,793)	923,936

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