

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

**SIEFORE SURA BASICA 85-89, 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	11	10	Acreedores	114,938	312,452
Bancos monedas extranjeras	398,613	180,201	Provisiones para gastos	7,057	14,601
Divisas por recibir	280,727	640,200	Divisas por entregar	533,337	763,342
	679,350	820,410	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	4,437,989	5,124,675
RESERVADOS					
Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en pesos	-	15,956			
	-	15,956			
INVERSIONES					
Inversión en valores de renta variable	18,358,999	15,123,583			
Plus (Minus) valia en valores de renta variable	1,121,228	1,418,825	TOTAL PASIVO	5,093,320	6,215,070
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	18,981,961	10,989,320			
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	1,315,039	1,593,322			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	33,741,320	26,900,215			
Plus (Minus) valia en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(1,895,699)	331,206			
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	1,488,082	1,559,960			
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	5,390	178,467			
Inversión en Depósito Banxico	11,975	8,458	CAPITAL CONTABLE	2022	2021
Plus (Minus) valia en Depósito Banxico	229	195	CAPITAL		
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	1,586,151	1,229,815	CAPITAL CONTRIBUIDO	16,865,709	6,124,471
Plus (Minus) valia instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	(1,577)	136,868	Capital soc al pagado	31,210,123	27,584,144
Inversión en FIBRAS	1,995,185	1,851,992	Prima en venta de acciones	(14,344,414)	(21,459,673)
Plus (Minus) valia en Inversión en FIBRAS	(259,248)	(232,186)	CAPITAL GANADO	75,330,520	68,225,131
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	18,466	2,563	Resultados de ejercicios anteriores	74,614,971	65,663,719
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	5,380	1	Resultados del ejercicio	715,549	2,561,411
Inversión en valores extranjeros de deuda	522,405	64,945	OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
Plus (Minus) valia en Inversión en valores extranjeros de deuda	262	4,410	PLUS (MINUS) VALÍAS	761,012	4,058,264
Inversión en títulos Fiduciarios	7,567,735	4,849,391			
Plus (minus) valia en Títulos Fiduciarios	592,915	342,561	TOTAL CAPITAL CONTABLE	92,957,241	78,407,865
Valores Prestados	282,125	-			
Plus (Minus) valia de valores prestados	(17,587)	-			
Inversión en Fondos Mutuos	4,400,564	4,370,720			
Plus (Minus) valia de Fondos Mutuos	(99,941)	284,595			
	89,721,358	71,009,227			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	476,258	115,360			
Div dendos o derechos por cobrar	40	11,090			
Intereses devengados sobre valores	750,318	562,824			
Reportos	2,963,674	6,290,659			
Premios por cobrar por préstamo de valores	5	-			
Intereses devengados sobre valores prestados	2,562	-			
Reembolsos y otros intereses	123	-			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	3,456,873	5,797,409			
	7,649,853	12,777,342			
TOTAL ACTIVO	98,050,561	84,622,935	TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	98,050,561	84,622,935

CUENTAS DE ORDEN	2022	2021	CUENTAS DE ORDEN	2022	2021
Valores entregados en custodia	89,432,974	71,006,663	Capital social autorizado	126,259,200	126,259,200
Valores prestados	264,538	-	Acciones emitidas	25,000,019,801	25,000,019,801
Garantías recibidas por valores prestados	277,358	(0)	Acciones en circulación, posición propia	34,486,475	33,980,898
Colaterales recibidos por reportos	2,964,299	6,287,248	Acciones de Siefores, posición de terceros	2	2
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	521,156	1,335,182	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	6,145,290,503	5,427,832,242
Bancos divisas en moneda extranjera	20,080	67,511			
Dólares americanos	19,773	8,281			
Yenes	-	59,230			
Otras Divisas	307	-			
Divisas por recibir	14,099	31,321			
Dólares americanos	14,099	31,321			
Divisas por entregar	26,786	37,346			
Dólares americanos	26,786	37,346			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	4,185,927	5,458,812			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	149,274,788	169,611,826			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	26,229,971	18,707,644			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	10,171,512	15,431,954			
Contratos Adelantados sobre Euros	1,075,552	4,386,751			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	1,012,161	1,965,087			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	11,713	222,442			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	35,869,757	32,213,301			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	21,918,155	32,553,425			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	3,373,711	3,594,946			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	119,905	119,905			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	27,456,379	29,947,671			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	22,034,908	30,381,005			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	1,065	87,696			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	121,918,168	155,270,125			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	3,697,456	1,785,884			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	6,111,589	18,465,359			
Contratos Adelantados sobre Euros	1,306,767	3,819,860			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	133,338	2,058,829			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	-	437,772			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	26,476,603	28,085,403			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	22,678,608	31,069,144			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	2,179,600	3,061,883			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	266,202	266,202			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	35,846,653	32,363,165			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	23,101,447	33,736,718			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	119,905	119,905			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$	761,012	\$	4,058,264
Un valor de los activos netos de:	\$	92,957,241	\$	78,407,865
El precio de la acción de:	\$	15.042168	\$	14.355648

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 85-89, 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	7,183,971	11,587,624
Intereses, dividendos, premios y derechos	1,289,330	739,938
Resultado cambiario / Otros productos	(53,133)	4,798
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	(885,010)	636,420
INGRESOS NETOS	7,535,160	12,968,781
Costo de ventas de valores	6,683,689	10,233,991
Gastos generales	5,729	8,012
Comisiones sobre saldos	124,565	159,909
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	5,628	5,457
EGRESOS NETOS	6,819,611	10,407,369
UTILIDAD DE OPERACIÓN	715,549	2,561,411
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(2,976,456)	(2,052,727)
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	(2,260,907)	508,685

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