

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 30 DE SEPTIEMBRE DE 2021 Y 2020

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2021	2020	PASIVO	2021	2020
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	11	10	Acreedores	270,796	277,519
Bancos monedas extranjeras	70,792	57,416	Provisiones para gastos	11,959	7,044
Divisas por recibir	6,345	98,831	Divisas por entregar	74,082	93,163
	77,147	156,257	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	5,718,290	8,759,046
INVERSIONES			TOTAL PASIVO	6,075,127	9,136,772
Inversión en valores de renta variable	21,321,492	19,323,163			
Plus (Minus) valia en valores de renta variable	2,066,070	382,637	CAPITAL CONTABLE	2021	2020
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	29,086,094	28,221,374	CAPITAL		
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	4,611,390	5,740,226	CAPITAL CONTRIBUIDO	33,713,188	27,802,295
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	45,858,001	31,796,671	Capital soc al pagado	49,872,286	47,658,044
Plus (Minus) valia en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(780,497)	2,093,339	Prima en venta de acciones	(16,159,098)	(19,855,749)
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	2,623,699	3,212,787	CAPITAL GANADO	94,761,206	80,352,181
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	548,775	590,902	Resultados de ejercicios anteriores	85,500,172	75,690,810
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	2,120,770	3,113,394	Resultados del ejercicio	9,261,034	4,661,371
Plus (Minus) valia instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	80,519	404,167	OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
Inversión en FIBRAS	3,819,784	3,571,339	PLUS (MINUS) VALÍAS	6,910,808	9,230,403
Plus (Minus) valia en Inversion en FIBRAS	(606,632)	(940,601)	TOTAL CAPITAL CONTABLE	135,385,202	117,384,879
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	-	1,347			
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	77	1			
Inversión en valores extranjeros de deuda	231,512	231,512			
Plus (Minus) valia en Inversión en valores extranjeros de deuda	6,619	23,526			
Inversión en títulos Fiduciarios	10,552,962	8,109,084			
Plus (minus) valia en Títulos Fiduciarios	349,221	372,961			
Valores Prestados	486,792	1,234,168			
Plus (Minus) valia de valores prestados	10,767	156,343			
Inversión en Fondos Mutuos	5,824,407	3,768,206			
Plus (Minus) valia de Fondos Mutuos	624,575	406,901			
	128,836,398	111,813,451			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	326,884	537,381			
Div dendos o derechos por cobrar	13,665	12,500			
Intereses devengados sobre valores	1,099,844	984,415			
Reportos	6,507,465	5,151,984			
Premios por cobrar por préstamo de valores	4	11			
Intereses devengados sobre valores prestados	12,053	11,630			
Reembolsos y otros intereses	858	483			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	4,586,011	7,853,539			
	12,546,783	14,551,943			
TOTAL ACTIVO	141,460,329	126,521,651	TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	141,460,329	126,521,651

CUENTAS DE ORDEN	2021	2020	CUENTAS DE ORDEN	2021	2020
Valores entregados en custodia	128,050,936	110,421,591	Capital social autorizado	126,259,200	126,259,200
Valores prestados	497,560	1,390,511	Acciones emitidas	25,000,019,801	25,000,019,801
Garantías recibidas por valores prestados	524,474	1,469,104	Acciones en circulación, posición propia	61,237,712	62,229,419
Colaterales recibidos por reportos	6,508,388	5,148,867	Acciones de Siefores, posición de terceros	2	2
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	802,911	1,126,368	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	9,813,750,684	9,374,326,782
Bancos divisas en moneda extranjera	3,443	55,330			
Dólares americanos	3,443	2,088			
Yenes	-	53,242			
Divisas por recibir	309	4,463			
Dólares americanos	309	4,463			
Divisas por entregar	3,603	4,207			
Dólares americanos	3,603	4,207			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	8,040,092	9,574,976			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	204,994,475	314,824,027			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	22,597,670	15,167,261			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	8,960,018	15,223,780			
Contratos Adelantados sobre Euros	1,069,165	4,177,141			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	1,477,679	-			
Contratos de Opciones sobre Renta Variable Nacional	-	2,803			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	40,828,950	89,626,261			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	43,122,962	42,281,374			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	5,541,250	5,356,623			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	249,598	249,598			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	36,106,011	107,006,713			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	45,039,465	35,591,801			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	1,708	140,672			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	188,932,296	302,935,594			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	5,300,572	890,820			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	10,971,947	17,852,758			
Contratos Adelantados sobre Euros	561,194	903,812			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	582,361	2,541,495			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	328,803	335,543			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	31,971,234	102,209,734			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	47,213,725	37,629,553			
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	43,657,321	92,406,608			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	44,452,132	43,426,402			
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:	\$ 6,910,808	\$ 9,230,403
Un valor de los activos netos de:	\$ 135,385,202	\$ 117,384,879
El precio de la acción de:	\$ 13.709910	\$ 12.439377

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 30 DE SEPTIEMBRE DE 2021 Y 2020

(Cifras en miles de pesos)

	2021	2020
Ingresos por la venta de Valores	34,602,824	34,315,136
Intereses, dividendos, premios y derechos	4,767,985	4,018,896
Resultado cambiario / Otros productos	35,545	150,923
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	2,021,044	(1,070,417)
INGRESOS NETOS	41,427,398	37,414,538
Costo de ventas de valores	31,310,615	31,964,119
Gastos generales	26,042	33,528
Comisiones sobre saldos	805,239	747,423
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	24,468	8,096
EGRESOS NETOS	32,166,364	32,753,166
UTILIDAD DE OPERACIÓN	9,261,034	4,661,371
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(4,484,193)	3,388,889
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	4,776,841	8,050,260

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 20 de julio de 2021 fueron aprobados los Estados Financieros al 30 de junio de 2021, asimismo los presentes Estados Financieros al 30 de septiembre de 2021 serán aprobados en la Sesión del Consejo de Administración con fecha 3 de noviembre de 2021