

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

**SIFORE SURA BASICA 60-64, 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	11	Acreedores	171,581	486,319
Bancos monedas extranjeras	84,314	83,001	Provisiones para gastos	11,699	2,981
Divisas por recibir	681,025	360,140	Divisas por entregar	312,758	383,629
	765,349	443,151	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	6,491,063	10,044,559
RESERVADOS			TOTAL PASIVO	6,987,102	10,917,488
Bancos Moneda Extr., Depósitos reserv. al pago compromisos futuros en divisas	-	219,089			
	-	219,089			
INVERSIONES			CAPITAL CONTABLE	2021	2020
Inversión en valores de renta variable	9,053,775	8,258,693	CAPITAL		
Plus (Minus) valia en valores de renta variable	1,016,855	(562,740)	CAPITAL CONTRIBUIDO	(66,977,574)	(61,389,052)
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	16,950,328	20,158,826	Capital social pagado	5,880,826	6,338,170
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	3,586,042	2,063,025	Prima en venta de acciones	(72,858,400)	(67,727,222)
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	26,537,243	21,496,916	CAPITAL GANADO	134,225,915	125,947,615
Plus (Minus) valia en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	439,531	348,767	Resultados de ejercicios anteriores	132,469,520	127,429,042
Depósito Traspaso Banxico	-	214,282	Resultados del ejercicio	1,756,395	(1,481,427)
Plus (Minus) valia en inversión en el Depósito Traspaso Banxico	-	3,313	OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	1,816,647	1,997,534	PLUS (MINUS) VALÍAS	5,937,974	2,063,901
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	382,406	248,370	TOTAL CAPITAL CONTABLE	73,186,315	66,622,464
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	2,894,863	3,476,506			
Plus (Minus) valia instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	390,388	119,924			
Inversión en FIBRAS	1,887,329	1,788,671			
Plus (Minus) valia en Inversión en FIBRAS	(281,948)	(571,808)			
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	1	317			
Inversión en valores extranjeros de deuda	145,426	145,426			
Plus (Minus) valia en Inversión en valores extranjeros de deuda	12,790	6,432			
Inversión en títulos Fiduciarios	2,838,196	2,913,130			
Plus (minus) valia en Títulos Fiduciarios	199,849	346,514			
Valores Prestados	405,521	18,504			
Plus (Minus) valia de valores prestados	21,347	615			
Inversión en Fondos Mutuos	2,051,643	827,807			
Plus (Minus) valia de Fondos Mutuos	170,714	61,490			
	70,518,948	63,360,513			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	146,585	14,299			
Dividendos o derechos por cobrar	17,145	29			
Intereses devengados sobre valores	761,273	724,825			
Reportos	2,638,215	3,939,639			
Premios por cobrar por préstamo de valores	26	3			
Intereses devengados sobre valores prestados	10,311	64			
Reembolsos y otros intereses	60	263			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	5,315,505	8,838,076			
	8,889,120	13,517,198			
TOTAL ACTIVO	80,173,417	77,539,952	TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	80,173,417	77,539,952

CUENTAS DE ORDEN		2021	2020	CUENTAS DE ORDEN		2021	2020
Valores entregados en custodia		70,027,243	63,088,057	Capital social autorizado		27,500,100	27,500,100
Valores prestados		426,868	19,119	Acciones emitidas		27,500,100,000	27,500,100,000
Garantías recibidas por valores prestados		456,346	19,793	Acciones en circulación, posición propia		36,905,188	47,359,960
Colaterales recibidos por reportos		2,635,318	3,949,539	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores		5,843,920,528	6,290,809,616
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)		774,815	1,096,462				
Bancos divisas en moneda extranjera		59,713	59,048				
Dólares americanos		3,618	2,362				
Euros		-	592				
Yenes		56,095	56,093				
Divisas por recibir		33,318	15,335				
Dólares americanos		33,318	15,335				
Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en moneda extranjera		-	9,329				
Dólares americanos		-	9,329				
Divisas por entregar		15,301	16,335				
Dólares americanos		15,301	16,335				
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios		2,835,122	3,149,949				
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga		198,462,070	297,668,867				
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera		6,950,003	5,942,971				
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano		13,011,214	8,938,290				
Contratos Adelantados sobre Euros		3,505,332	1,195,857				
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas		1,018,712	53,062				
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional		-	132,804				
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos		39,303,092	93,989,792				
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano		49,507,807	41,680,432				
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS		4,892,944	2,477,493				
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros		337,691	3,537,339				
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos		31,345,525	98,506,903				
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano		48,529,268	37,798,073				
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros		-	3,355,369				
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional		60,483	60,483				
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta		192,558,557	291,930,667				
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera		799,517	342,197				
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano		13,391,385	8,982,233				
Contratos Adelantados sobre Euros		2,815,163	778,343				
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas		1,252,957	98,181				
Contratos Futuros sobre Dólar Americano		315,603	320,253				
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos		27,084,134	94,718,474				
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano		50,065,961	39,334,766				
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS		3,212,648	3,212,648				
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros		518,978	3,874,347				
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos		41,851,041	94,122,073				
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano		50,913,481	42,609,813				
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros		337,691	3,537,339				

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó

Una plus (minus) valía de:	\$	5,937,974	\$	2,063,901
Un valor de los activos netos de:	\$	73,186,315	\$	66,622,464
El precio de la acción de:	\$	12.444905	\$	10.511310

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 60-64, 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	5,462,571	8,553,735
Intereses, dividendos, premios y derechos	881,687	900,029
Resultado cambiario / Otros productos	(5,122)	(46,059)
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	389,686	(2,370,313)
INGRESOS NETOS	6,728,822	7,037,392
Costo de ventas de valores	4,807,677	8,352,197
Gastos generales	7,083	9,176
Comisiones sobre saldos	154,422	156,689
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	3,245	758
EGRESOS NETOS	4,972,426	8,518,820
UTILIDAD DE OPERACIÓN	1,756,395	(1,481,428)
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(1,952,419)	(1,650,560)
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	(196,024)	(3,131,987)

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