

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

**SIEFORE SURA BASICA 65-69, 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	11	11	Acreedores	316,802	559,713
Bancos monedas extranjeras	36,025	48,231	Provisiones para gastos	16,900	3,646
Divisas por recibir	754,322	502,282	Divisas por entregar	512,771	505,197
	790,358	550,524	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	2,588,445	3,680,789
RESERVADOS			TOTAL PASIVO	3,434,917	4,749,345
Bancos Moneda Extr., Depósitos reserv. al pago compromisos futuros en divisas	-	287,460			
	-	287,460			
INVERSIONES			CAPITAL CONTABLE	2021	2020
Inversión en valores de renta variable	13,619,907	9,666,841	CAPITAL		
Plus (Minus) valia en valores de renta variable	1,271,603	(753,734)	CAPITAL CONTRIBUIDO	84,681,800	86,579,367
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	25,680,267	30,379,487	Capital social pagado	91,244,614	92,944,259
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	5,119,775	3,169,306	Prima en venta de acciones	(6,562,814)	(6,364,892)
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	34,213,878	29,515,422	CAPITAL GANADO	10,436,223	(1,386,543)
Plus (Minus) valia en inversión en el Depósito Traspaso Banxico	630,384	495,326	Resultados de ejercicios anteriores	8,052,653	423,588
Depósito Traspaso Banxico	398,587	87,254	Resultados del ejercicio	2,383,571	(1,810,131)
Plus (Minus) valia en inversión en el Depósito Traspaso Banxico	9,209	1,349	OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	2,772,060	2,799,019	PLUS (MINUS) VALÍAS	7,762,224	3,176,291
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	530,662	338,568	TOTAL CAPITAL CONTABLE	102,880,247	88,369,115
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	1,204,780	2,509,118			
Plus (Minus) valia instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	125,868	97,835			
Inversión en FIBRAS	2,767,665	2,681,334			
Plus (Minus) valia en Inversión en FIBRAS	(420,743)	(854,022)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	3,683	-			
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	1	421			
Inversión en valores extranjeros de deuda	243,057	243,057			
Plus (Minus) valia en Inversión en valores extranjeros de deuda	16,326	6,459			
Inversión en títulos Fiduciarios	6,482,010	5,462,048			
Plus (minus) valia en Títulos Fiduciarios	197,354	597,148			
Valores Prestados	365,868	26,334			
Plus (Minus) valia de valores prestados	19,380	1,032			
Inversión en Fondos Mutuos	3,505,192	1,103,128			
Plus (Minus) valia de Fondos Mutuos	262,407	77,022			
	99,019,180	87,649,753			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	125,505	496,042			
Dividendos o derechos por cobrar	15,410	49			
Intereses devengados sobre valores	1,000,340	1,000,320			
Reportos	2,997,439	1,048,039			
Premios por cobrar por préstamo de valores	10	0			
Intereses devengados sobre valores prestados	9,306	661			
Reembolsos y otros intereses	-	348			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	2,357,616	2,085,263			
	6,505,626	4,630,722			
TOTAL ACTIVO	106,315,164	93,118,459	TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	106,315,164	93,118,459

CUENTAS DE ORDEN	2021	2020	CUENTAS DE ORDEN	2021	2020
Valores entregados en custodia	98,630,247	87,621,966	Capital social autorizado	35,000,100	35,000,100
Valores prestados	385,248	27,366	Acciones emitidas	35,000,100,000	35,000,100,000
Garantías recibidas por valores prestados	410,032	28,707	Acciones en circulación, posición propia	51,448,050	62,932,560
Colaterales recibidos por reportos	2,996,291	1,050,548	Acciones de Siefos, posición de terceros	1	1
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	634,610	350,241	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	8,241,488,092	8,384,479,025
Bancos divisas en moneda extranjera	1,762	1,987			
Dólares americanos	1,762	1,327			
Euros	-	661			
Divisas por recibir	36,904	21,388			
Dólares americanos	36,904	21,388			
Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en moneda extranjera	-	12,240			
Dólares americanos	-	12,240			
Divisas por entregar	25,087	21,512			
Dólares americanos	25,087	21,512			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	5,268,176	4,884,189			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	81,641,601	46,495,874			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	13,311,350	8,965,142			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	12,754,895	5,580,102			
Contratos Adelantados sobre Euros	4,408,351	1,303,256			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	1,448,281	72,165			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	-	256,754			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	11,907,816	3,138,713			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	9,953,556	5,669,006			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	1,935,656	694,934			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	63,623	1,139,835			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	10,666,055	9,360,700			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	15,111,754	9,014,520			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	-	1,220,482			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	80,264	80,264			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	74,956,014	40,291,957			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	1,142,326	452,338			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	17,801,699	8,077,298			
Contratos Adelantados sobre Euros	4,023,051	877,236			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	1,815,342	133,529			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	9,659,900	8,724,000			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	16,282,881	10,061,010			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	1,702,328	1,702,328			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	390,650	1,611,132			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	11,749,067	1,844,245			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	10,325,148	5,669,006			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	63,623	1,139,835			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó

Una plus (minus) valía de:	\$ 7,762,224	\$ 3,176,291
Un valor de los activos netos de:	\$ 102,880,247	\$ 88,369,115
El precio de la acción de:	\$ 12.405769	\$ 10.461088

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 65-69, 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	7,936,685	10,964,501
Intereses, dividendos, premios y derechos	1,138,872	1,176,290
Resultado cambiario / Otros productos	(7,309)	(59,138)
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	557,342	(3,041,827)
INGRESOS NETOS	9,625,590	9,039,825
Costo de ventas de valores	7,016,185	10,633,223
Gastos generales	6,005	8,190
Comisiones sobre saldos	214,820	207,537
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	5,010	1,006
EGRESOS NETOS	7,242,019	10,849,956
UTILIDAD DE OPERACIÓN	2,383,571	(1,810,131)
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(2,663,437)	(2,335,126)
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	(279,866)	(4,145,256)

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.