

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 30 DE SEPTIEMBRE DE 2021 Y 2020

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2021	2020	PASIVO	2021	2020
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	10	10	Acreedores	294,256	239,803
Bancos monedas extranjeras	59,622	41,986	Provisiones para gastos	11,682	6,445
Divisas por recibir	-	90,330	Divisas por entregar	92,134	91,547
	59,631	132,325	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	1,996,295	2,646,363
RESERVADOS			TOTAL PASIVO	2,394,366	2,984,158
Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en pesos	34,620	-			
	34,620	-			
INVERSIONES			CAPITAL CONTABLE	2021	2020
Inversión en valores de renta variable	20,625,608	18,258,405	CAPITAL		
Plus (Minus) valia en valores de renta variable	1,792,371	411,791	CAPITAL CONTRIBUIDO	95,120,431	86,810,370
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	24,280,234	22,112,206	Capital soc al pagado	98,810,341	91,666,000
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	3,203,730	4,147,893	Prima en venta de acciones	(3,689,910)	(4,855,629)
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	39,977,956	26,586,356	CAPITAL GANADO	17,327,063	3,449,046
Plus (Minus) valia en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(661,749)	1,852,663	Resultados de ejercicios anteriores	8,077,210	458,674
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	2,211,080	2,645,163	Resultados del ejercicio	9,249,854	2,990,372
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	369,241	388,507	OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	974,132	1,688,260	PLUS (MINUS) VALÍAS	5,254,284	7,258,926
Plus (Minus) valia instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	28,417	170,514	TOTAL CAPITAL CONTABLE	117,701,778	97,518,343
Inversión en FIBRAS	3,140,564	2,913,122			
Plus (Minus) valia en Inversion en FIBRAS	(449,828)	(733,447)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	4,291	2,173			
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	75	1			
Inversión en valores extranjeros de deuda	127,188	127,188			
Plus (Minus) valia en Inversión en valores extranjeros de deuda	4,453	13,635			
Inversión en títulos Fiduciarios	8,941,446	6,539,502			
Plus (minus) valia en Títulos Fiduciarios	399,626	444,827			
Valores Prestados	725,491	1,196,388			
Plus (Minus) valia de valores prestados	(20,598)	156,172			
Inversión en Fondos Mutuos	5,948,207	3,686,041			
Plus (Minus) valia de Fondos Mutuos	588,621	406,372			
	112,210,556	93,013,732			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	286,690	451,655			
Divendos o derechos por cobrar	13,850	11,640			
Intereses devengados sobre valores	904,219	762,655			
Reportos	5,070,901	3,247,346			
Premios por cobrar por préstamo de valores	4	11			
Intereses devengados sobre valores prestados	16,856	13,626			
Reembolsos y otros intereses	1,118	1,518			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	1,497,699	2,867,991			
	7,791,337	7,356,442			
TOTAL ACTIVO	120,096,144	100,502,500	TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	120,096,144	100,502,500

CUENTAS DE ORDEN	2021	2020	CUENTAS DE ORDEN	2021	2020
Valores entregados en custodia	111,214,696	91,352,598	Capital social autorizado	35,000,100	35,000,100
Valores prestados	704,894	1,352,560	Acciones emitidas	35,000,100,000	35,000,100,000
Garantías recibidas por valores prestados	753,564	1,434,567	Acciones en circulación, posición propia	61,202,547	58,864,761
Colaterales recibidos por reportos	5,068,302	3,247,639	Acciones de Siefores, posición de terceros	1	1
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	610,141	1,424,160	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	9,819,831,542	9,107,735,206
Bancos divisas en moneda extranjera	2,899	1,896			
Dólares americanos	2,899	1,896			
Divisas por recibir	-	4,079			
Dólares americanos	-	4,079			
Divisas por entregar	4,481	4,134			
Dólares americanos	4,481	4,134			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	7,084,850	8,558,495			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	90,867,733	62,126,469			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	24,969,071	15,184,956			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	9,353,088	11,942,748			
Contratos Adelantados sobre Euros	1,020,813	3,956,992			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	1,853,171	-			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	506,066	434,655			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	13,403,622	4,554,531			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	10,757,610	7,949,705			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	1,885,839	1,924,803			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	161,504	161,504			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	12,417,350	8,502,097			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	14,537,932	7,377,081			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	1,668	137,394			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	71,553,207	53,317,367			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	4,965,196	958,853			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	12,036,041	18,265,798			
Contratos Adelantados sobre Euros	459,734	805,343			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	613,227	2,540,007			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	40,493	39,733			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	11,206,200	7,446,500			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	15,970,014	8,700,352			
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	13,253,938	4,441,874			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	11,120,162	8,156,467			
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:	\$	5,254,284	\$	7,258,926
Un valor de los activos netos de:	\$	117,701,778	\$	97,518,343
El precio de la acción de:	\$	11.911889	\$	10.638442

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 30 DE SEPTIEMBRE DE 2021 Y 2020

(Cifras en miles de pesos)

	2021	2020
Ingresos por la venta de Valores	34,726,105	30,502,257
Intereses, dividendos, premios y derechos	4,037,670	3,216,347
Resultado cambiario / Otros productos	53,231	109,024
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	2,649,211	(1,327,889)
INGRESOS NETOS	41,466,218	32,499,740
Costo de ventas de valores	31,478,737	28,866,597
Gastos generales	23,067	22,551
Comisiones sobre saldos	689,965	612,080
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	24,595	8,140
EGRESOS NETOS	32,216,364	29,509,367
UTILIDAD DE OPERACIÓN	9,249,854	2,990,372
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(4,064,474)	3,237,924
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	5,185,379	6,228,297

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