

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

**SIEFORE SURA BASICA INICIAL, 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	1,478	16,832
Bancos monedas extranjeras	22,476	11,259	Provisiones para gastos	1,100	470
Divisas por recibir	-	6,771	Divisas por entregar	27,938	6,863
	22,486	18,040	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	212,059	275,917
INVERSIONES			TOTAL PASIVO	242,574	300,081
Inversión en valores de renta variable	2,380,069	1,242,179			
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	172,838	31,526			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	2,388,232	1,215,595			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	157,488	220,270			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	4,936,551	1,957,580			
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(82,220)	138,392			
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	131,834	192,427			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	20,323	23,433			
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	122,910	143,155			
Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	5,602	21,087			
Inversión en FIBRAS	250,213	173,984			
Plus (Minus) valía en Inversión en FIBRAS	(22,925)	(41,742)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	786	186			
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	5	-			
Inversión en valores extranjeros de deuda	8,239	8,239			
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	(199)	389			
Inversión en títulos Fiduciarios	806,863	488,877			
Plus (minus) valía en Títulos Fiduciarios	(13,683)	30,547			
Valores Prestados	-	192,022			
Plus (Minus) valía de valores prestados	-	32,904			
Inversión en Fondos Mutuos	556,201	275,751			
Plus (Minus) valía de Fondos Mutuos	41,222	26,379			
	11,860,350	6,373,178			
DEUDORES DIVERSOS			CAPITAL CONTABLE	2021	2020
Liquidadora	13,858	37,138	CAPITAL		
Dividendos o derechos por cobrar	1,416	783	CAPITAL CONTRIBUIDO	10,530,507	6,241,078
Intereses devengados sobre valores	84,926	48,704	Capital social pagado	10,282,078	6,542,118
Reportos	383,997	487,740	Prima en venta de acciones	248,428	(301,040)
Premios por cobrar por préstamo de valores	-	6			
Intereses devengados sobre valores prestados	-	2,445	CAPITAL GANADO	1,474,392	244,651
Reembolsos y otros intereses	37	33	Resultados de ejercicios anteriores	607,453	28,698
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	158,851	300,928	Resultados del ejercicio	866,939	215,953
	643,085	877,776	OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
			PLUS (MINUS) VALÍAS	278,447	483,184
TOTAL ACTIVO	12,525,921	7,268,994	TOTAL CAPITAL CONTABLE	12,283,346	6,968,913
			TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	12,525,921	7,268,994

CUENTAS DE ORDEN	2021	2020	CUENTAS DE ORDEN	2021	2020
Valores entregados en custodia	11,844,959	6,148,067	Capital social autorizado	35,000,100	35,000,100
Valores prestados	-	224,926	Acciones emitidas	35,000,100,000	35,000,100,000
Garantías recibidas por valores prestados	-	239,188	Acciones en circulación, posición propia	5,230,606	3,418,009
Colaterales recibidos por reportos	384,166	488,068	Acciones de Siefores, posición de terceros	1	1
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	84,516	155,299	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	826,214,764	525,600,870
Bancos divisas en moneda extranjera	1,093	508			
Dólares americanos	1,093	508			
Divisas por recibir	-	306			
Dólares americanos	-	306			
Divisas por entregar	1,359	310			
Dólares americanos	1,359	310			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	729,160	871,042			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	9,001,092	5,087,582			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	2,878,387	1,244,683			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	1,001,412	1,135,192			
Contratos Adelantados sobre Euros	130,221	348,921			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	197,338	-			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	64,681	26,377			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	1,498,727	465,657			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	784,238	541,372			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	184,912	257,285			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	9,788	9,788			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	1,272,984	647,881			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	978,299	401,676			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	106	8,752			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	6,454,585	4,200,888			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	449,964	66,737			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	1,080,162	1,507,371			
Contratos Adelantados sobre Euros	54,665	65,303			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	79,425	191,418			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	1,093,800	482,300			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	1,081,290	496,754			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	156,008	156,008			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	13,421	29,521			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	1,584,356	600,471			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	851,705	595,216			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	9,788	9,788			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$	278,447	\$	483,184
Un valor de los activos netos de:	\$	12,283,346	\$	6,968,913
El precio de la acción de:	\$	14.773485	\$	13.173278

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 INICIAL, 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	4,734,864	2,020,427
Intereses, dividendos, premios y derechos	371,436	216,124
Resultado cambiario / Otros productos	405	7,221
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	250,358	(71,944)
INGRESOS NETOS	5,357,062	2,171,828
Costo de ventas de valores	4,418,808	1,912,009
Gastos generales	2,631	1,719
Comisiones sobre saldos	66,534	41,588
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	2,149	559
EGRESOS NETOS	4,490,123	1,955,875
UTILIDAD DE OPERACIÓN	866,939	215,953
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(368,875)	240,591
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	498,064	456,544

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