

**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**

**ESTADO DE SITUACIÓN FINANCIERA AL 31 DE MARZO DE 2021 Y 2020**

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2021	2020	PASIVO	2021	2020
<b>DISPONIBLE</b>			<b>OBLIGACIONES</b>		
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
	<b>765,349</b>	<b>443,151</b>	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	6,491,063	10,044,559
<b>RESERVADOS</b>			<b>TOTAL PASIVO</b>	<b>6,987,102</b>	<b>10,917,488</b>
Bancos Moneda Extr., Depósitos reserv. al pago compromisos futuros en divisas	-	219,089			
	-	<b>219,089</b>			
<b>INVERSIONES</b>			<b>CAPITAL CONTABLE</b>	<b>2021</b>	<b>2020</b>
Inversión en valores de renta variable	9,053,775	8,258,693	<b>CAPITAL</b>		
Plus (Minus) valia en valores de renta variable	1,016,855	(562,740)	<b>CAPITAL CONTRIBUIDO</b>	<b>(66,977,574)</b>	<b>(61,389,052)</b>
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	<b>CAPITAL GANADO</b>	<b>134,225,915</b>	<b>125,947,615</b>
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	<b>OTROS RESULTADOS INTEGRALES</b>		
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	<b>TOTAL CAPITAL CONTABLE</b>	<b>73,186,315</b>	<b>66,622,464</b>
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			
	<b>70,518,948</b>	<b>63,360,513</b>			
<b>DEUDORES DIVERSOS</b>					
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			
	<b>8,889,120</b>	<b>13,517,198</b>			
<b>TOTAL ACTIVO</b>	<b>80,173,417</b>	<b>77,539,952</b>	<b>TOTAL PASIVO MAS CAPITAL</b>	<b>80,173,417</b>	<b>77,539,952</b>

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)

	<b>2021</b>	<b>2020</b>
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)
<b>INGRESOS NETOS</b>	<b>6,728,822</b>	<b>7,037,392</b>
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
<b>EGRESOS NETOS</b>	<b>4,972,426</b>	<b>8,518,820</b>
<b>UTILIDAD DE OPERACIÓN</b>	<b>1,756,395</b>	<b>(1,481,428)</b>
<b>OTROS RESULTADOS INTEGRALES</b>		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(1,952,419)	(1,650,560)
<b>UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO</b>	<b>(196,024)</b>	<b>(3,131,987)</b>

\_\_\_\_\_  
**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