

**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 2022 Y 2021**

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2022	2021	PASIVO	2022	2021
<b>DISPONIBLE</b>			<b>OBLIGACIONES</b>		
Bancos moneda nacional	10	10	Acreedores	738,629	171,581
Bancos monedas extranjeras	514,644	84,314	Provisiones para gastos	3,799	11,699
Divisas por recibir	1,295,337	681,025	Divisas por entregar	480,669	312,758
	<b>1,809,990</b>	<b>765,349</b>	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	3,614,718	6,491,063
<b>INVERSIONES</b>			<b>TOTAL PASIVO</b>	<b>4,837,814</b>	<b>6,987,102</b>
Inversión en valores de renta variable	12,785,643	9,053,775			
Plus (Minus) valia en valores de renta variable	586,518	1,016,855	<b>CAPITAL CONTABLE</b>	<b>2022</b>	<b>2021</b>
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	22,380,500	16,950,328	<b>CAPITAL</b>		
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	3,381,981	3,586,042	<b>CAPITAL CONTRIBUIDO</b>	<b>(68,731,118)</b>	<b>(66,977,574)</b>
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	22,265,520	26,537,243	Capital soc al pagado	5,743,963	5,880,826
Plus (Minus) valia en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	<b>(1,272,926)</b>	439,531	Prima en venta de acciones	<b>(74,475,080)</b>	<b>(72,858,400)</b>
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	1,545,491	1,816,647	<b>CAPITAL GANADO</b>	<b>139,782,146</b>	<b>134,225,915</b>
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	133,029	382,406	Resultados de ejercicios anteriores	138,437,550	132,469,520
Inversión en Depósito Banxico	5,162	-	Resultados del ejercicio	1,344,596	1,756,395
Plus (Minus) valia en Depósito Banxico	99	-	<b>OTROS RESULTADOS INTEGRALES</b>		
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	1,618,670	2,894,863	PLUS (MINUS) VALÍAS	2,938,223	5,937,974
Plus (Minus) valia instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	52,020	390,388	<b>TOTAL CAPITAL CONTABLE</b>	<b>73,989,251</b>	<b>73,186,315</b>
Inversión en FIBRAS	1,925,707	1,887,329			
Plus (Minus) valia en Inversion en FIBRAS	<b>(328,488)</b>	<b>(281,948)</b>			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	8,266	-			
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	3,710	1			
Inversión en valores extranjeros de deuda	145,426	145,426			
Plus (Minus) valia en Inversión en valores extranjeros de deuda	1,656	12,790			
Inversión en títulos Fiduciarios	3,312,128	2,838,196			
Plus (minus) valia en Títulos Fiduciarios	390,272	199,849			
Valores Prestados	-	405,521			
Plus (Minus) valia de valores prestados	-	21,347			
Inversión en Fondos Mutuos	2,017,054	2,051,643			
Plus (Minus) valia de Fondos Mutuos	<b>(5,938)</b>	170,714			
	<b>70,951,501</b>	<b>70,518,948</b>			
<b>DEUDORES DIVERSOS</b>					
Liquidadora	888,633	146,585			
Divendos o derechos por cobrar	30	17,145			
Intereses devengados sobre valores	778,851	761,273			
Reportos	1,855,184	2,638,215			
Premios por cobrar por préstamo de valores	-	26			
Intereses devengados sobre valores prestados	-	10,311			
Reembolsos y otros intereses	1,691	60			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	2,541,185	5,315,505			
	<b>6,065,574</b>	<b>8,889,120</b>			
<b>TOTAL ACTIVO</b>	<b>78,827,065</b>	<b>80,173,417</b>	<b>TOTAL PASIVO MAS CAPITAL</b>	<b>78,827,065</b>	<b>80,173,417</b>

CUENTAS DE ORDEN	2022	2021	CUENTAS DE ORDEN	2022	2021
Valores entregados en custodia	70,606,122	70,027,243	Capital social autorizado	27,500,100	27,500,100
Valores prestados	-	426,868	Acciones emitidas	27,500,100,000	27,500,100,000
Garantías recibidas por valores prestados	0	456,346	Acciones en circulación, posición propia	32,434,445	36,905,188
Colaterales recibidos por reportos	1,855,577	2,635,318	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	5,711,528,081	5,843,920,528
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	489,760	774,815			
Bancos divisas en moneda extranjera	25,880	59,713			
Dólares americanos	25,712	3,618			
Yenes	-	56,095			
Otras Divisas	169	-			
Divisas por recibir	65,056	33,318			
Dólares americanos	65,056	33,318			
Divisas por entregar	24,141	15,301			
Dólares americanos	24,141	15,301			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	2,406,340	2,835,122			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	118,519,204	198,462,070			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	1,726,992	6,950,003			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	5,104,975	13,011,214			
Contratos Adelantados sobre Euros	823,406	3,505,332			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	195,387	1,018,712			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	49,125,759	39,303,092			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	13,197,054	49,507,807			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	4,567,176	4,892,944			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	337,691	337,691			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	32,247,935	31,345,525			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	11,192,094	48,529,268			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	734	60,483			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	119,777,208	192,558,557			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	375,531	799,517			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	7,741,510	13,391,385			
Contratos Adelantados sobre Euros	518,960	2,815,163			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	405,968	1,252,957			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	-	315,603			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	28,515,334	27,084,134			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	12,650,185	50,065,961			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	2,683,983	3,212,648			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	518,978	518,978			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	51,426,341	41,851,041			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	14,602,729	50,913,481			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	337,691	337,691			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$ 2,938,223	\$ 5,937,974
Un valor de los activos netos de:	\$ 73,989,251	\$ 73,186,315
El precio de la acción de:	\$ 12.881221	\$ 12.444905

**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 2022 Y 2021**

(Cifras en miles de pesos)

	<b>2022</b>	<b>2021</b>
Ingresos por la venta de Valores	7,376,094	5,462,571
Intereses, dividendos, premios y derechos	1,332,617	881,687
Resultado cambiario / Otros productos	(37,398)	(5,122)
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	(31,219)	389,686
<b>INGRESOS NETOS</b>	<b>8,640,093</b>	<b>6,728,822</b>
Costo de ventas de valores	7,186,528	4,807,677
Gastos generales	4,537	7,083
Comisiones sobre saldos	101,776	154,422
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	2,657	3,245
<b>EGRESOS NETOS</b>	<b>7,295,497</b>	<b>4,972,426</b>
<b>UTILIDAD DE OPERACIÓN</b>	<b>1,344,596</b>	<b>1,756,395</b>
<b>OTROS RESULTADOS INTEGRALES</b>		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(2,791,750)	(1,952,419)
<b>UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO</b>	<b>(1,447,154)</b>	<b>(196,024)</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 24 de Enero de 2022 fueron aprobados los Estados Financieros del 31 de Diciembre de 2021, asimismo los presentes Estados Financieros al 31 de Marzo de 2022 serán aprobados en la Sesión del Consejo de Administración con fecha 18 de Abril de 2022