

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

**SIEFORE SURA BASICA 75-79, 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
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	10	10	Acreedores	497,460	547,710
Bancos monedas extranjeras	681,305	51,184	Provisiones para gastos	9,694	22,544
Divisas por recibir	469,179	810,916	Divisas por entregar	744,771	819,120
	1,150,493	862,111	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	5,576,802	7,020,014
INVERSIONES			TOTAL PASIVO	6,828,728	8,409,388
Inversión en valores de renta variable	25,566,239	21,243,271			
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	1,654,664	2,090,066			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	37,064,547	24,305,299			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	4,056,594	4,573,161			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	43,859,699	40,242,338			
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(2,706,937)	558,700			
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	2,644,618	2,986,019			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	159,145	509,979			
Inversión en Depósito Banxico	4,894	4,431			
Plus (Minus) valía en Depósito Banxico	94	102			
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	2,306,200	2,548,011			
Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	(40,628)	271,198			
Inversión en FIBRAS	3,874,611	3,676,125			
Plus (Minus) valía en Inversión en FIBRAS	(636,529)	(573,750)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	6,384	6,578			
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	8,630	2			
Inversión en valores extranjeros de deuda	540,202	231,512			
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	(10,767)	14,537			
Inversión en títulos Fiduciarios	12,312,954	9,022,942			
Plus (minus) valía en Títulos Fiduciarios	743,171	423,544			
Valores Prestados	398,189	806,249			
Plus (Minus) valía de valores prestados	(2,206)	42,151			
Inversión en Fondos Mutuos	5,779,354	5,788,984			
Plus (Minus) valía de Fondos Mutuos	(71,121)	451,840			
	137,512,001	119,223,293			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	1,169,607	149,149			
Dividendos o derechos por cobrar	66	27,051			
Intereses devengados sobre valores	1,288,760	1,046,723			
Reportos	3,349,630	7,995,871			
Premios por cobrar por préstamo de valores	8	32			
Intereses devengados sobre valores prestados	5,215	20,493			
Reembolsos y otros intereses	3,118	866			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	4,195,836	6,479,895			
	10,012,241	15,720,080			
TOTAL ACTIVO	148,674,735	135,805,484			
			CAPITAL CONTABLE	2022	2021
			CAPITAL		
			CAPITAL CONTRIBUIDO	38,448,320	30,142,818
			Capital social pagado	51,597,670	48,552,140
			Prima en venta de acciones	(13,149,349)	(18,409,322)
			CAPITAL GANADO	100,252,208	88,891,748
			Resultados de ejercicios anteriores	98,266,176	85,500,172
			Resultados del ejercicio	1,986,032	3,391,577
			OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
			PLUS (MINUS) VALÍAS	3,145,479	8,361,530
			TOTAL CAPITAL CONTABLE	141,846,008	127,396,096
			TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	148,674,735	135,805,484

CUENTAS DE ORDEN	2022	2021	CUENTAS DE ORDEN	2022	2021
Valores entregados en custodia	136,488,979	118,079,487	Capital social autorizado	126,259,200	126,259,200
Valores prestados	395,983	848,400	Acciones emitidas	25,000,019,801	25,000,019,801
Garantías recibidas por valores prestados	417,547	909,073	Acciones en circulación, posición propia	57,009,847	59,672,590
Colaterales recibidos por reportos	3,350,336	8,001,936	Acciones de Siefores, posición de terceros	2	2
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	728,243	937,509	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	10,159,614,132	9,553,919,678
Bancos divisas en moneda extranjera	34,303	55,265			
Dólares americanos	33,867	2,023			
Yenes	-	53,242			
Otras Divisas	436	-			
Divisas por recibir	23,564	39,673			
Dólares americanos	23,564	39,673			
Divisas por entregar	37,405	40,074			
Dólares americanos	37,405	40,074			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	7,122,246	9,021,353			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	182,729,380	223,435,786			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	27,793,652	21,940,069			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	13,579,647	20,226,813			
Contratos Adelantados sobre Euros	1,279,812	6,002,647			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	592,941	2,220,367			
Contratos de Opciones sobre Renta Variable Nacional	-	2,803			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	48,389,721	42,444,150			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	26,539,932	42,030,453			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	5,297,405	5,938,946			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	249,598	249,598			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	36,455,011	40,800,275			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	22,549,953	41,438,994			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	1,708	140,672			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	159,499,424	207,990,565			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	4,626,046	2,191,984			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	12,458,039	24,162,129			
Contratos Adelantados sobre Euros	1,602,086	5,244,634			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	1,032,742	2,859,708			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	-	330,671			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	32,320,234	35,819,434			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	24,660,948	43,613,254			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	3,184,497	4,030,361			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	458,911	458,911			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	51,037,221	45,670,257			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	27,869,103	43,359,623			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	249,598	249,598			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$ 3,145,479	\$ 8,361,530
Un valor de los activos netos de:	\$ 141,846,008	\$ 127,396,096
El precio de la acción de:	\$ 13.883843	\$ 13.251664

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 75-79, 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)

	2022	2021
Ingresos por la venta de Valores	13,641,687	12,960,670
Intereses, dividendos, premios y derechos	2,117,248	1,323,588
Resultado cambiario / Otros productos	(51,026)	(11,763)
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	(541,997)	790,248
INGRESOS NETOS	15,165,912	15,062,742
Costo de ventas de valores	12,972,739	11,388,167
Gastos generales	8,132	10,754
Comisiones sobre saldos	191,509	264,492
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	7,500	7,753
EGRESOS NETOS	13,179,880	11,671,166
UTILIDAD DE OPERACIÓN	1,986,032	3,391,577
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(4,701,427)	(3,033,472)
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	(2,715,395)	358,105

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