

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 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	512,150	163,814
Bancos monedas extranjeras	545,684	77,227	Provisiones para gastos	4,866	3,717
Divisas por recibir	5,905	46,674	Divisas por entregar	2,216	40,792
	551,598	123,910	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	4,108,941	8,397,551
INVERSIONES			TOTAL PASIVO	4,628,174	8,605,873
Inversión en valores de renta variable	8,513,988	9,615,832			
Plus (Minus) valia en valores de renta variable	1,080,913	351,641			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	20,324,490	18,908,824			
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	3,752,359	4,064,893			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	28,622,528	23,163,380			
Plus (Minus) valia en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(474,225)	1,487,382			
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	1,555,220	2,228,258			
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	397,906	450,291			
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	1,865,797	3,011,922			
Plus (Minus) valia instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	84,730	404,854			
Inversión en FIBRAS	1,950,244	1,792,977			
Plus (Minus) valia en Inversion en FIBRAS	(295,715)	(487,948)			
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	33	0			
Inversión en valores extranjeros de deuda	145,426	145,426			
Plus (Minus) valia en Inversión en valores extranjeros de deuda	7,944	18,099			
Inversión en títulos Fiduciarios	3,082,966	2,780,393			
Plus (minus) valia en Títulos Fiduciarios	460,461	106,513			
Valores Prestados	277,581	636,032			
Plus (Minus) valia de valores prestados	6,598	113,719			
Inversión en Fondos Mutuos	2,063,743	1,636,736			
Plus (Minus) valia de Fondos Mutuos	232,527	202,634			
	73,655,515	70,631,860			
DEUDORES DIVERSOS			CAPITAL CONTABLE	2021	2020
Liquidadora	24,516	354,568	CAPITAL		
Dividendos o derechos por cobrar	4,910	6,434	CAPITAL CONTRIBUIDO	(68,087,895)	(61,952,652)
Intereses devengados sobre valores	783,724	720,413	Capital social pagado	5,793,753	6,291,708
Reportos	288,918	4,349,825	Prima en venta de acciones	(73,881,648)	(68,244,360)
Premios por cobrar por préstamo de valores	3	3			
Intereses devengados sobre valores prestados	7,219	8,151			
Reembolsos y otros intereses	104	246			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	3,452,076	7,258,698			
	4,561,470	12,698,338	CAPITAL GANADO	136,974,806	130,088,809
			Resultados de ejercicios anteriores	132,469,520	127,429,042
			Resultados del ejercicio	4,505,286	2,659,766
			OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
			PLUS (MINUS) VALÍAS	5,253,499	6,712,079
			TOTAL CAPITAL CONTABLE	74,140,409	74,848,236
TOTAL ACTIVO	78,768,583	83,454,109	TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	78,768,583	83,454,109

CUENTAS DE ORDEN	2021	2020	CUENTAS DE ORDEN	2021	2020
Valores entregados en custodia	73,261,899	69,882,108	Capital social autorizado	27,500,100	27,500,100
Valores prestados	284,180	749,752	Acciones emitidas	27,500,100,000	27,500,100,000
Garantías recibidas por valores prestados	298,532	796,392	Acciones en circulación, posición propia	36,590,014	41,879,649
Colaterales recibidos por reportos	289,046	4,349,265	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	5,757,163,154	6,249,828,774
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	680,581	902,768			
Bancos divisas en moneda extranjera	26,538	59,050			
Dólares americanos	26,538	2,956			
Yenes	-	56,095			
Divisas por recibir	287	2,108			
Dólares americanos	287	2,108			
Divisas por entregar	108	1,842			
Dólares americanos	108	1,842			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	2,562,489	3,043,502			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	148,148,049	315,181,041			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	6,612,368	5,663,495			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	2,875,517	11,512,945			
Contratos Adelantados sobre Euros	672,671	2,332,342			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	384,272	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	34,456,492	90,650,992			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	30,979,606	49,891,205			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	4,567,176	4,124,535			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	337,691	337,691			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	32,247,935	105,746,591			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	35,013,586	44,860,763			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	734	60,483			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	143,524,127	307,598,018			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	1,993,660	421,511			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	3,207,503	9,662,665			
Contratos Adelantados sobre Euros	189,600	366,517			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	149,357	1,148,002			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	313,821	320,253			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	28,515,334	101,593,034			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	36,550,279	46,397,456			
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	36,678,641	92,430,383			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	32,385,281	51,188,880			
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:	\$	5,253,499	\$	6,712,079
Un valor de los activos netos de:	\$	74,140,409	\$	74,848,236
El precio de la acción de:	\$	12.796612	\$	11.896329

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 30 DE SEPTIEMBRE DE 2021 Y 2020

(Cifras en miles de pesos)

	2021	2020
Ingresos por la venta de Valores	15,911,778	20,223,388
Intereses, dividendos, premios y derechos	2,719,450	2,751,772
Resultado cambiario / Otros productos	29,197	74,551
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	725,293	(920,907)
INGRESOS NETOS	19,385,718	22,128,803
Costo de ventas de valores	14,397,191	18,952,624
Gastos generales	16,735	23,574
Comisiones sobre saldos	457,312	489,050
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	9,195	3,788
EGRESOS NETOS	14,880,432	19,469,037
UTILIDAD DE OPERACIÓN	4,505,286	2,659,766
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(2,636,895)	2,997,618
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	1,868,391	5,657,385

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