

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

**SIEFORE SURA BASICA 70-74, 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	564,764	293,984
Bancos monedas extranjeras	81,832	40,738	Provisiones para gastos	11,561	7,240
Divisas por recibir	-	87,893	Divisas por entregar	60,243	89,071
	81,842	128,640	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	2,319,431	2,898,893
INVERSIONES			TOTAL PASIVO	2,956,000	3,289,188
Inversión en valores de renta variable	19,465,679	17,893,384			
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	1,876,024	325,382			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	35,023,673	33,805,918			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	5,966,900	7,319,053			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	49,534,513	36,084,836			
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(779,786)	2,365,935			
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	2,984,245	3,785,487			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	689,347	767,725			
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	1,034,510	1,895,541			
Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	57,238	214,416			
Inversión en FIBRAS	4,174,237	3,906,643			
Plus (Minus) valía en Inversión en FIBRAS	(650,321)	(1,040,460)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	4,563	-			
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	68	1			
Inversión en valores extranjeros de deuda	320,649	320,649			
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	8,306	31,716			
Inversión en títulos Fiduciarios	10,230,401	8,320,315			
Plus (minus) valía en Títulos Fiduciarios	449,078	403,966			
Valores Prestados	782,738	1,525,428			
Plus (Minus) valía de valores prestados	8,293	188,773			
Inversión en Fondos Mutuos	5,429,266	3,652,570			
Plus (Minus) valía de Fondos Mutuos	580,523	391,277			
	137,190,146	122,158,555			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	7,268	594,807			
Dividendos o derechos por cobrar	12,722	14,608			
Intereses devengados sobre valores	1,252,847	1,134,855			
Reportos	5,950,163	6,151,235			
Premios por cobrar por préstamo de valores	7	16			
Intereses devengados sobre valores prestados	18,708	18,591			
Reembolsos y otros intereses	-	470			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	1,600,690	2,403,643			
	8,842,405	10,318,225			
TOTAL ACTIVO	146,114,393	132,605,421			
			CAPITAL CONTABLE	2021	2020
			CAPITAL		
			CAPITAL CONTRIBUIDO	114,302,620	112,512,749
			Capital social pagado	121,840,470	120,428,580
			Prima en venta de acciones	(7,537,850)	(7,915,831)
			CAPITAL GANADO	20,650,171	5,835,701
			Resultados de ejercicios anteriores	11,143,336	611,322
			Resultados del ejercicio	9,506,836	5,224,379
			OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
			PLUS (MINUS) VALÍAS	8,205,602	10,967,783
			TOTAL CAPITAL CONTABLE	143,158,394	129,316,233
			TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	146,114,393	132,605,421

CUENTAS DE ORDEN	2021	2020	CUENTAS DE ORDEN	2021	2020
Valores entregados en custodia	136,394,484	120,444,353	Capital social autorizado	35,000,100	35,000,100
Valores prestados	791,031	1,714,201	Acciones emitidas	35,000,100,000	35,000,100,000
Garantías recibidas por valores prestados	828,266	1,819,576	Acciones en circulación, posición propia	75,553,315	79,651,578
Colaterales recibidos por reportos	5,947,208	6,151,540	Acciones de Siefores, posición de terceros	1	1
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	331,978	1,069,357	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	12,108,493,678	11,963,206,420
Bancos divisas en moneda extranjera	3,980	1,840			
Dólares americanos	3,980	1,840			
Divisas por recibir	-	3,969			
Dólares americanos	-	3,969			
Divisas por entregar	2,930	4,022			
Dólares americanos	2,930	4,022			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	7,303,563	8,674,168			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	104,493,358	71,108,976			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	21,059,787	14,725,293			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	8,465,088	10,189,981			
Contratos Adelantados sobre Euros	508,477	3,784,211			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	1,359,589	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	21,984,808	7,207,671			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	14,533,275	10,352,816			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	1,889,555	1,178,798			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	90,540	90,540			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	15,214,317	12,396,277			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	19,386,394	11,057,607			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	1,527	125,783			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	92,894,319	63,161,816			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	5,176,229	803,122			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	13,200,089	16,497,136			
Contratos Adelantados sobre Euros	515,510	781,495			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	504,768	2,397,742			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	14,564,400	11,942,800			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	20,694,837	12,213,715			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	1,792,702	1,792,702			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	266,123	266,123			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	21,076,963	5,741,481			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	15,012,159	10,634,960			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	90,540	90,540			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$	8,205,602	\$	10,967,783
Un valor de los activos netos de:	\$	143,158,394	\$	129,316,233
El precio de la acción de:	\$	11.749659	\$	10.738002

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 70-74, 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	34,132,763	35,899,738
Intereses, dividendos, premios y derechos	5,052,360	4,566,239
Resultado cambiario / Otros productos	45,168	154,153
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	1,979,402	(938,727)
INGRESOS NETOS	41,209,692	39,681,403
Costo de ventas de valores	30,804,446	33,595,761
Gastos generales	20,177	23,199
Comisiones sobre saldos	855,210	830,120
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	23,024	7,943
EGRESOS NETOS	31,702,857	34,457,023
UTILIDAD DE OPERACIÓN	9,506,836	5,224,379
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(4,955,722)	4,145,100
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	4,551,114	9,369,480

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