

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

**SIEFORE SURA BASICA 90-94, 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	2,487	82,153
Bancos monedas extranjeras	26,646	16,595	Provisiones para gastos	4,467	2,176
Divisas por recibir	-	31,432	Divisas por entregar	96,007	31,858
	26,657	48,037	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	824,700	1,004,752
INVERSIONES			TOTAL PASIVO	927,662	1,120,939
Inversión en valores de renta variable	8,570,248	6,296,412			
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	737,411	177,941			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	8,508,199	6,502,545			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	779,342	1,186,954			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	17,966,186	9,343,732			
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(383,063)	670,693			
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	694,845	852,108			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	99,879	112,338			
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	382,389	582,381			
Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	7,833	60,334			
Inversión en FIBRAS	980,911	869,920			
Plus (Minus) valía en Inversión en FIBRAS	(121,067)	(208,712)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	1,675	1,872			
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	22	0			
Inversión en valores extranjeros de deuda	34,621	34,621			
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	2,015	4,399			
Inversión en títulos Fiduciarios	3,147,150	1,985,056			
Plus (minus) valía en Títulos Fiduciarios	96,258	142,972			
Valores Prestados	-	263,602			
Plus (Minus) valía de valores prestados	-	46,046			
Inversión en Fondos Mutuos	2,295,943	1,283,676			
Plus (Minus) valía de Fondos Mutuos	196,162	122,799			
	43,996,960	30,331,690			
DEUDORES DIVERSOS			CAPITAL CONTABLE	2021	2020
Liquidadora	122,279	146,685	CAPITAL		
Dividendos o derechos por cobrar	5,476	3,913	CAPITAL CONTRIBUIDO	38,062,353	28,930,285
Intereses devengados sobre valores	345,091	240,794	Capital social pagado	38,231,965	30,335,456
Reportos	1,596,569	1,712,493	Prima en venta de acciones	(169,612)	(1,405,170)
Premios por cobrar por préstamo de valores	-	8	CAPITAL GANADO	6,325,481	1,184,969
Intereses devengados sobre valores prestados	-	3,367	Resultados de ejercicios anteriores	2,800,827	122,675
Reembolsos y otros intereses	621	712	Resultados del ejercicio	3,524,654	1,062,294
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	636,614	1,064,261	OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
	2,706,650	3,172,231	PLUS (MINUS) VALÍAS	1,414,771	2,315,764
			TOTAL CAPITAL CONTABLE	45,802,605	32,431,019
TOTAL ACTIVO	46,730,266	33,551,958	TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	46,730,266	33,551,958

CUENTAS DE ORDEN	2021	2020	CUENTAS DE ORDEN	2021	2020
Valores entregados en custodia	43,842,663	29,855,770	Capital social autorizado	35,000,100	35,000,100
Valores prestados	-	309,648	Acciones emitidas	35,000,100,000	35,000,100,000
Garantías recibidas por valores prestados	-	332,206	Acciones en circulación, posición propia	19,152,969	15,802,810
Colaterales recibidos por reportos	1,595,926	1,714,093	Acciones de Siefores, posición de terceros	1	1
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	235,670	524,226	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	3,072,419,470	2,437,229,862
Bancos divisas en moneda extranjera	1,296	749			
Dólares americanos	1,295	749			
Divisas por recibir	-	1,419			
Dólares americanos	-	1,419			
Divisas por entregar	4,669	1,439			
Dólares americanos	4,669	1,439			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	2,381,471	2,877,565			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	37,396,564	23,507,561			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	10,722,289	5,218,019			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	3,658,485	4,039,871			
Contratos Adelantados sobre Euros	511,297	1,380,762			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	824,218	-			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	117,461	120,738			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	7,354,756	3,402,410			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	3,548,213	2,691,634			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	542,819	542,819			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	48,941	48,941			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	5,808,125	3,734,807			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	4,259,465	2,286,880			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	494	40,682			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	28,163,248	20,384,420			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	1,759,004	310,468			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	4,264,527	6,034,359			
Contratos Adelantados sobre Euros	224,870	306,171			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	194,548	867,274			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	5,198,550	3,181,450			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	4,760,164	2,749,989			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	702,414	702,414			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	62,888	141,493			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	7,278,214	3,285,614			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	3,669,129	2,756,247			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	48,941	48,941			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$	1,414,771	\$	2,315,764
Un valor de los activos netos de:	\$	45,802,605	\$	32,431,019
El precio de la acción de:	\$	14.815310	\$	13.220786

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 90-94, 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	14,251,201	8,453,763
Intereses, dividendos, premios y derechos	1,482,062	1,028,569
Resultado cambiario / Otros productos	7,384	30,973
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	1,037,619	(222,671)
INGRESOS NETOS	16,778,266	9,290,634
Costo de ventas de valores	12,977,271	8,024,336
Gastos generales	9,174	7,010
Comisiones sobre saldos	257,991	194,396
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	9,176	2,598
EGRESOS NETOS	13,253,612	8,228,340
UTILIDAD DE OPERACIÓN	3,524,654	1,062,294
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(1,608,052)	1,173,397
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	1,916,602	2,235,691

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