

**COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO**

**SIFORE SURA BASICA 85-89, 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 2021 Y 2020**

(Cifras en miles de pesos)

<b>ACTIVO</b>	<b>2021</b>	<b>2020</b>	<b>PASIVO</b>	<b>2021</b>	<b>2020</b>
<b>DISPONIBLE</b>			<b>OBLIGACIONES</b>		
Bancos moneda nacional	10	10	Acreedores	312,452	272,102
Bancos monedas extranjeras	180,201	75,545	Provisiones para gastos	14,601	2,994
Divisas por recibir	640,200	526,189	Divisas por entregar	763,342	544,846
	<b>820,410</b>	<b>601,744</b>	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	5,124,675	8,933,229
<b>RESERVADOS</b>			<b>TOTAL PASIVO</b>	<b>6,215,070</b>	<b>9,753,171</b>
Bancos Moneda Nal., Depósitos reserv. al pago compromisos futuros en pesos	15,956	-			
	<b>15,956</b>	<b>-</b>			
<b>INVERSIONES</b>			<b>CAPITAL CONTABLE</b>	<b>2021</b>	<b>2020</b>
Inversión en valores de renta variable	15,123,583	10,191,221	<b>CAPITAL</b>		
Plus (Minus) valia en valores de renta variable	1,418,825	(737,604)	<b>CAPITAL CONTRIBUIDO</b>	<b>6,124,471</b>	<b>(3,636,852)</b>
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	10,989,320	12,775,371	Capital social pagado	27,584,144	23,951,466
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	1,593,322	1,046,797	Prima en venta de acciones	(21,459,673)	(27,588,318)
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	26,900,215	17,080,393	<b>CAPITAL GANADO</b>	<b>68,225,131</b>	<b>56,905,832</b>
Plus (Minus) valia en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	331,206	334,258	Resultados de ejercicios anteriores	65,663,719	59,885,630
Depósito Traspaso Banxico	8,458	5,433	Resultados del ejercicio	2,561,411	(2,979,798)
Plus (Minus) valia en inversión en el Depósito Traspaso Banxico	195	84	<b>OTROS RESULTADOS INTEGRALES</b>		
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	1,559,960	1,495,387	PLUS (MINUS) VALÍAS	4,058,264	668,980
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	178,467	33,831			
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	1,229,815	3,298,704	<b>TOTAL CAPITAL CONTABLE</b>	<b>78,407,865</b>	<b>53,937,960</b>
Plus (Minus) valia instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	136,868	115,391			
Inversión en FIBRAS	1,851,992	1,756,666			
Plus (Minus) valia en Inversión en FIBRAS	(232,186)	(523,768)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	2,563	-			
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	1	460			
Inversión en valores extranjeros de deuda	64,945	64,945			
Plus (Minus) valia en Inversión en valores extranjeros de deuda	4,410	1,757			
Inversión en títulos Fiduciarios	4,849,391	3,362,958			
Plus (minus) valia en Títulos Fiduciarios	342,561	305,383			
Valores Prestados	-	252,930			
Plus (Minus) valia de valores prestados	-	10,687			
Inversión en Fondos Mutuos	4,370,720	1,106,141			
Plus (Minus) valia de Fondos Mutuos	284,595	82,165			
	<b>71,009,227</b>	<b>52,059,589</b>			
<b>DEUDORES DIVERSOS</b>					
Liquidadora	115,360	16,731			
Dividendos o derechos por cobrar	11,090	40			
Intereses devengados sobre valores	562,824	511,747			
Reportos	6,290,659	3,297,512			
Premios por cobrar por préstamo de valores	-	12			
Intereses devengados sobre valores prestados	-	4,299			
Reembolsos y otros intereses	-	351			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	5,797,409	7,199,105			
	<b>12,777,342</b>	<b>11,029,798</b>			
<b>TOTAL ACTIVO</b>	<b>84,622,935</b>	<b>63,691,130</b>	<b>TOTAL PASIVO MAS CAPITAL</b>	<b>84,622,935</b>	<b>63,691,130</b>

CUENTAS DE ORDEN	2021	2020	CUENTAS DE ORDEN	2021	2020
Valores entregados en custodia	71,006,663	51,795,512	Capital social autorizado	126,259,200	126,259,200
Valores prestados	-	263,617	Acciones emitidas	25,000,019,801	25,000,019,801
Garantías recibidas por valores prestados	(0)	276,513	Acciones en circulación, posición propia	33,980,898	34,093,992
Colaterales recibidos por reportos	6,287,248	3,300,496	Acciones de Siefos, posición de terceros	2	2
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	1,335,182	788,160	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	5,427,832,242	4,708,428,675
Bancos divisas en moneda extranjera	67,511	61,859			
Dólares americanos	8,281	2,267			
Euros	-	364			
Yenes	59,230	59,229			
Divisas por recibir	31,321	22,406			
Dólares americanos	31,321	22,406			
Divisas por entregar	37,346	23,200			
Dólares americanos	37,346	23,200			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	5,458,812	3,516,958			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	169,611,826	228,433,227			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	18,707,644	8,936,335			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	15,431,954	7,349,477			
Contratos Adelantados sobre Euros	4,386,751	1,187,240			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	1,965,087	60,719			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	222,442	720,462			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	32,213,301	75,948,223			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	32,553,425	29,184,072			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	3,594,946	3,332,328			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	119,905	1,907,095			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	29,947,671	73,263,604			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	30,381,005	24,604,211			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	-	1,851,766			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	87,696	87,696			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	155,270,125	223,015,908			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	1,785,884	472,970			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	18,465,359	11,209,932			
Contratos Adelantados sobre Euros	3,819,860	796,455			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	2,058,829	112,348			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	437,772	442,719			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	28,085,403	71,757,998			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	31,069,144	25,217,172			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	3,061,883	3,061,883			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	266,202	2,117,968			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	32,363,165	75,910,965			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	33,736,718	30,008,403			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	119,905	1,907,095			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó

Una plus (minus) valía de:	\$	4,058,264	\$	668,980
Un valor de los activos netos de:	\$	78,407,865	\$	53,937,960
El precio de la acción de:	\$	14.355648	\$	11.373263

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 85-89, 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 2021 Y 2020**

(Cifras en miles de pesos)

	<b>2021</b>	<b>2020</b>
Ingresos por la venta de Valores	11,587,624	8,482,402
Intereses, dividendos, premios y derechos	739,938	688,357
Resultado cambiario / Otros productos	4,798	(47,149)
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	636,420	(3,588,127)
<b>INGRESOS NETOS</b>	<b>12,968,781</b>	<b>5,535,483</b>
Costo de ventas de valores	10,233,991	8,377,786
Gastos generales	8,012	9,553
Comisiones sobre saldos	159,909	126,929
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	5,457	1,013
<b>EGRESOS NETOS</b>	<b>10,407,369</b>	<b>8,515,281</b>
<b>UTILIDAD DE OPERACIÓN</b>	<b>2,561,411</b>	<b>(2,979,798)</b>
<b>OTROS RESULTADOS INTEGRALES</b>		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(2,052,727)	(1,657,070)
<b>UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO</b>	<b>508,685</b>	<b>(4,636,868)</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 28 de enero de 2021 fueron aprobados los Estados Financieros al 31 de diciembre de 2020, asimismo los presentes Estados Financieros al 31 de marzo del 2021 serán aprobados en la Sesión del Consejo de Administración con fecha 5 de mayo de 2021