

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

**SIEFORE SURA BASICA INICIAL, 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)

ACTIVO	2021	2020	PASIVO	2021	2020
<b>DISPONIBLE</b>			<b>OBLIGACIONES</b>		
Bancos moneda nacional	10	10	Acreedores	62,169	25,794
Bancos monedas extranjeras	69,399	23,828	Provisiones para gastos	1,770	286
Divisas por recibir	108,674	54,009	Divisas por entregar	137,925	54,099
	<b>178,083</b>	<b>77,847</b>	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	290,146	365,945
<b>RESERVADOS</b>			<b>TOTAL PASIVO</b>	<b>492,010</b>	<b>446,125</b>
Bancos Moneda Nal., Depósitos reserv. al pago compromisos futuros en pesos	3,634	-			
	<b>3,634</b>	<b>-</b>			
<b>INVERSIONES</b>			<b>CAPITAL CONTABLE</b>	<b>2021</b>	<b>2020</b>
Inversión en valores de renta variable	1,969,090	965,969	<b>CAPITAL</b>		
Plus (Minus) valia en valores de renta variable	173,621	(71,943)	<b>CAPITAL CONTRIBUIDO</b>	<b>8,495,644</b>	<b>5,620,722</b>
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	1,323,454	1,416,098	Capital social pagado	8,549,918	5,932,819
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	154,037	113,528	Prima en venta de acciones	(54,274)	(312,097)
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	4,029,432	1,712,017	<b>CAPITAL GANADO</b>	<b>928,423</b>	<b>(297,237)</b>
Plus (Minus) valia en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	25,187	32,255	Resultados de ejercicios anteriores	607,453	28,698
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	144,358	152,273	Resultados del ejercicio	320,970	(325,935)
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	17,438	4,201	<b>OTROS RESULTADOS INTEGRALES</b>		
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	100,131	251,294	PLUS (MINUS) VALÍAS	421,585	75,998
Plus (Minus) valia instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	13,017	7,154			
Inversión en FIBRAS	218,514	173,550	<b>TOTAL CAPITAL CONTABLE</b>	<b>9,845,652</b>	<b>5,399,483</b>
Plus (Minus) valia en Inversion en FIBRAS	(22,029)	(51,746)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	-	966			
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	0	46			
Inversión en valores extranjeros de deuda	8,239	8,239			
Plus (Minus) valia en Inversión en valores extranjeros de deuda	105	(145)			
Inversión en títulos Fiduciarios	570,138	340,572			
Plus (minus) valia en Títulos Fiduciarios	34,975	30,467			
Valores Prestados	-	91,110			
Plus (Minus) valia de valores prestados	-	4,487			
Inversión en Fondos Mutuos	552,355	110,846			
Plus (Minus) valia de Fondos Mutuos	25,232	7,739			
	<b>9,337,296</b>	<b>5,298,978</b>			
<b>DEUDORES DIVERSOS</b>					
Liquidadora	10,805	1,765			
Dividendos o derechos por cobrar	1,165	5			
Intereses devengados sobre valores	64,978	51,365			
Reportos	354,798	234,921			
Premios por cobrar por préstamo de valores	-	5			
Intereses devengados sobre valores prestados	-	319			
Reembolsos y otros intereses	-	35			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	386,904	180,368			
	<b>818,649</b>	<b>468,783</b>			
<b>TOTAL ACTIVO</b>	<b>10,337,661</b>	<b>5,845,607</b>	<b>TOTAL PASIVO MAS CAPITAL</b>	<b>10,337,661</b>	<b>5,845,607</b>

CUENTAS DE ORDEN	2021	2020	CUENTAS DE ORDEN	2021	2020
Valores entregados en custodia	9,337,296	5,157,358	Capital social autorizado	35,000,100	35,000,100
Valores prestados	-	95,597	Acciones emitidas	35,000,100,000	35,000,100,000
Garantías recibidas por valores prestados	-	97,530	Acciones en circulación, posición propia	4,403,080	3,453,720
Colaterales recibidos por reportos	354,408	235,423	Acciones de Siefos, posición de terceros	1	1
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	195,025	18,748	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	686,973,656	476,295,084
Bancos divisas en moneda extranjera	3,395	935			
Dólares americanos	3,395	143			
Euros	-	792			
Divisas por recibir	5,317	2,300			
Dólares americanos	5,317	2,300			
Divisas por entregar	6,748	2,304			
Dólares americanos	6,748	2,304			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	835,135	372,139			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	8,790,753	3,734,459			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	2,402,506	939,389			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	2,222,852	275,437			
Contratos Adelantados sobre Euros	574,352	104,193			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	202,937	6,158			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	11,985	71,936			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	985,181	918,557			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	642,098	432,299			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	184,912	129,273			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	9,788	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	669,684	523,000			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	875,708	325,466			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	8,752	8,752			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	7,162,230	3,366,114			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	237,841	47,510			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	2,762,514	853,154			
Contratos Adelantados sobre Euros	497,994	79,523			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	234,943	11,394			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	490,500	410,800			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	978,699	420,544			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	156,008	156,008			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	29,521	29,521			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	1,054,856	925,360			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	709,565	432,299			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	9,788	-			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó

Una plus (minus) valía de:	\$	421,585	\$	75,998
Un valor de los activos netos de:	\$	9,845,652	\$	5,399,483
El precio de la acción de:	\$	14.240646	\$	11.254813

**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 INICIAL, 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	1,643,011	828,828
Intereses, dividendos, premios y derechos	78,958	68,767
Resultado cambiario / Otros productos	637	(881)
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	95,853	(393,912)
<b>INGRESOS NETOS</b>	<b>1,818,459</b>	<b>502,801</b>
Costo de ventas de valores	1,476,289	815,256
Gastos generales	959	734
Comisiones sobre saldos	19,641	12,645
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	601	101
<b>EGRESOS NETOS</b>	<b>1,497,489</b>	<b>828,736</b>
<b>UTILIDAD DE OPERACIÓN</b>	<b>320,970</b>	<b>(325,935)</b>
<b>OTROS RESULTADOS INTEGRALES</b>		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(225,737)	(166,595)
<b>UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO</b>	<b>95,233</b>	<b>(492,530)</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