

**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**

**ESTADO DE SITUACIÓN FINANCIERA AL 31 DE MARZO DE 2022 Y 2021**

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2022	2021	PASIVO	2022	2021
<b>DISPONIBLE</b>			<b>OBLIGACIONES</b>		
Bancos moneda nacional	11	10	Acreedores	114,938	312,452
Bancos monedas extranjeras	398,613	180,201	Provisiones para gastos	7,057	14,601
Divisas por recibir	280,727	640,200	Divisas por entregar	533,337	763,342
	<b>679,350</b>	<b>820,410</b>	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	4,437,989	5,124,675
<b>RESERVADOS</b>					
Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en pesos	-	15,956			
	-	<b>15,956</b>			
<b>INVERSIONES</b>					
Inversión en valores de renta variable	18,358,999	15,123,583			
Plus (Minus) valia en valores de renta variable	1,121,228	1,418,825	<b>TOTAL PASIVO</b>	<b>5,093,320</b>	<b>6,215,070</b>
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	18,981,961	10,989,320			
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	1,315,039	1,593,322			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	33,741,320	26,900,215			
Plus (Minus) valia en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	<b>(1,895,699)</b>	331,206			
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	1,488,082	1,559,960			
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	5,390	178,467	<b>CAPITAL CONTABLE</b>	<b>2022</b>	<b>2021</b>
Inversión en Depósito Banxico	11,975	8,458	<b>CAPITAL</b>		
Plus (Minus) valia en Depósito Banxico	229	195	<b>CAPITAL CONTRIBUIDO</b>	<b>16,865,709</b>	<b>6,124,471</b>
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	1,586,151	1,229,815	Capital soc al pagado	31,210,123	27,584,144
Plus (Minus) valia instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	<b>(1,577)</b>	136,868	Prima en venta de acciones	<b>(14,344,414)</b>	<b>(21,459,673)</b>
Inversión en FIBRAS	1,995,185	1,851,992	<b>CAPITAL GANADO</b>	<b>75,330,520</b>	<b>68,225,131</b>
Plus (Minus) valia en Inversión en FIBRAS	<b>(259,248)</b>	<b>(232,186)</b>	Resultados de ejercicios anteriores	74,614,971	65,663,719
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	18,466	2,563	Resultados del ejercicio	715,549	2,561,411
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	5,380	1	<b>OTROS RESULTADOS INTEGRALES</b>		
Inversión en valores extranjeros de deuda	522,405	64,945	PLUS (MINUS) VALÍAS	761,012	4,058,264
Plus (Minus) valia en Inversión en valores extranjeros de deuda	262	4,410			
Inversión en títulos Fiduciarios	7,567,735	4,849,391	<b>TOTAL CAPITAL CONTABLE</b>	<b>92,957,241</b>	<b>78,407,865</b>
Plus (minus) valia en Títulos Fiduciarios	592,915	342,561			
Valores Prestados	282,125	-			
Plus (Minus) valia de valores prestados	<b>(17,587)</b>	-			
Inversión en Fondos Mutuos	4,400,564	4,370,720			
Plus (Minus) valia de Fondos Mutuos	<b>(99,941)</b>	284,595			
	<b>89,721,358</b>	<b>71,009,227</b>			
<b>DEUDORES DIVERSOS</b>					
Liquidadora	476,258	115,360			
Div dendos o derechos por cobrar	40	11,090			
Intereses devengados sobre valores	750,318	562,824			
Reportos	2,963,674	6,290,659			
Premios por cobrar por préstamo de valores	5	-			
Intereses devengados sobre valores prestados	2,562	-			
Reembolsos y otros intereses	123	-			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	3,456,873	5,797,409			
	<b>7,649,853</b>	<b>12,777,342</b>			
<b>TOTAL ACTIVO</b>	<b>98,050,561</b>	<b>84,622,935</b>	<b>TOTAL PASIVO MAS CAPITAL</b>	<b>98,050,561</b>	<b>84,622,935</b>

CUENTAS DE ORDEN	2022	2021	CUENTAS DE ORDEN	2022	2021
Valores entregados en custodia	89,432,974	71,006,663	Capital social autorizado	126,259,200	126,259,200
Valores prestados	264,538	-	Acciones emitidas	25,000,019,801	25,000,019,801
Garantías recibidas por valores prestados	277,358	(0)	Acciones en circulación, posición propia	34,486,475	33,980,898
Colaterales recibidos por reportos	2,964,299	6,287,248	Acciones de Siefores, posición de terceros	2	2
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	521,156	1,335,182	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	6,145,290,503	5,427,832,242
Bancos divisas en moneda extranjera	20,080	67,511			
Dólares americanos	19,773	8,281			
Yenes	-	59,230			
Otras Divisas	307	-			
Divisas por recibir	14,099	31,321			
Dólares americanos	14,099	31,321			
Divisas por entregar	26,786	37,346			
Dólares americanos	26,786	37,346			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	4,185,927	5,458,812			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	149,274,788	169,611,826			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	26,229,971	18,707,644			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	10,171,512	15,431,954			
Contratos Adelantados sobre Euros	1,075,552	4,386,751			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	1,012,161	1,965,087			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	11,713	222,442			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	35,869,757	32,213,301			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	21,918,155	32,553,425			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	3,373,711	3,594,946			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	119,905	119,905			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	27,456,379	29,947,671			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	22,034,908	30,381,005			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	1,065	87,696			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	121,918,168	155,270,125			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	3,697,456	1,785,884			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	6,111,589	18,465,359			
Contratos Adelantados sobre Euros	1,306,767	3,819,860			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	133,338	2,058,829			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	-	437,772			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	26,476,603	28,085,403			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	22,678,608	31,069,144			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	2,179,600	3,061,883			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	266,202	266,202			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	35,846,653	32,363,165			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	23,101,447	33,736,718			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	119,905	119,905			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$	761,012	\$	4,058,264
Un valor de los activos netos de:	\$	92,957,241	\$	78,407,865
El precio de la acción de:	\$	15.042168	\$	14.355648

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 2022 Y 2021**

(Cifras en miles de pesos)

	<b>2022</b>	<b>2021</b>
Ingresos por la venta de Valores	7,183,971	11,587,624
Intereses, dividendos, premios y derechos	1,289,330	739,938
Resultado cambiario / Otros productos	(53,133)	4,798
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	(885,010)	636,420
<b>INGRESOS NETOS</b>	<b>7,535,160</b>	<b>12,968,781</b>
Costo de ventas de valores	6,683,689	10,233,991
Gastos generales	5,729	8,012
Comisiones sobre saldos	124,565	159,909
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	5,628	5,457
<b>EGRESOS NETOS</b>	<b>6,819,611</b>	<b>10,407,369</b>
<b>UTILIDAD DE OPERACIÓN</b>	<b>715,549</b>	<b>2,561,411</b>
<b>OTROS RESULTADOS INTEGRALES</b>		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(2,976,456)	(2,052,727)
<b>UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO</b>	<b>(2,260,907)</b>	<b>508,685</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 24 de Enero de 2022 fueron aprobados los Estados Financieros del 31 de Diciembre de 2021, asimismo los presentes Estados Financieros al 31 de Marzo de 2022 serán aprobados en la Sesión del Consejo de Administración con fecha 18 de Abril de 2022