

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

**SIEFORE SURA BASICA 55-59, 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	10	40,841
Bancos monedas extranjeras	85,518	14,133	Provisiones para gastos	642	774
Divisas por recibir	-	100,302	Divisas por entregar	1,279	4,139
	85,528	114,445	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	861,137	1,511,251
INVERSIONES			TOTAL PASIVO	863,067	1,557,004
Inversión en valores de renta variable	497,381	947,265			
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	52,355	53,398			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	7,355,196	7,729,736			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	1,781,139	1,946,375			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	6,656,023	7,333,286			
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(50,336)	511,372			
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	340,537	525,764			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	87,111	98,950			
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	492,105	740,840			
Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	23,854	83,963			
Inversión en FIBRAS	601,256	578,311			
Plus (Minus) valía en Inversión en FIBRAS	(103,748)	(169,958)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	1,217	-			
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	3	0			
Inversión en valores extranjeros de deuda	141,591	141,591			
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	26,382	33,520			
Valores Prestados	-	448,231			
Plus (Minus) valía de valores prestados	-	73,208			
Inversión en Fondos Mutuos	145,350	152,686			
Plus (Minus) valía de Fondos Mutuos	18,452	23,172			
	18,065,869	21,251,711			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	48	87,198			
Dividendos o derechos por cobrar	385	1,236			
Intereses devengados sobre valores	228,183	231,184			
Reportos	228,337	783,242			
Premios por cobrar por préstamo de valores	-	2			
Intereses devengados sobre valores prestados	-	7,210			
Reembolsos y otros intereses	1,022	929			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	596,086	1,164,626			
	1,054,061	2,275,627			
TOTAL ACTIVO	19,205,459	23,641,783			
			CAPITAL CONTABLE	2021	2020
			CAPITAL		
			CAPITAL CONTRIBUIDO	2,288,074	6,788,494
			Capital social pagado	5,639,340	7,032,788
			Prima en venta de acciones	(3,351,266)	(244,294)
			CAPITAL GANADO	14,219,107	12,642,284
			Resultados de ejercicios anteriores	13,096,011	11,560,947
			Resultados del ejercicio	1,123,096	1,081,336
			OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
			PLUS (MINUS) VALÍAS	1,835,210	2,654,001
			TOTAL CAPITAL CONTABLE	18,342,392	22,084,779
			TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	19,205,459	23,641,783

CUENTAS DE ORDEN	2021	2020	CUENTAS DE ORDEN	2021	2020
Valores entregados en custodia	17,809,050	20,466,672	Capital social autorizado	11,354,689	11,354,689
Valores prestados	-	521,440	Acciones emitidas	3,200,028,183	3,200,028,183
Garantías recibidas por valores prestados	-	558,590	Acciones en circulación, posición propia	10,843,322	13,193,112
Colaterales recibidos por reportos	228,438	783,512	Acciones de Siefores, posición de terceros	1,127	1,127
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	174,614	247,395	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	1,578,459,175	1,968,816,822
Bancos divisas en moneda extranjera	3,769	5,714			
Dólares americanos	1,291	590			
Euros	2,478	-			
Yenes	-	5,125			
Divisas por recibir	-	4,530			
Dólares americanos	-	4,530			
Divisas por entregar	62	187			
Dólares americanos	62	187			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	20,906,657	35,340,348			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	593,403	502,051			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	736,501	2,336,626			
Contratos Adelantados sobre Euros	-	423,568			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	31,943	-			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	202,465	206,615			
Contratos de Opciones sobre Renta Variable Nacional	-	52			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	7,193,237	9,542,427			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	2,226,173	4,263,141			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	1,201,498	1,226,684			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	36,706	36,706			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	6,492,746	13,186,672			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	2,187,265	3,611,084			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	4,722	4,722			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	20,279,813	34,118,198			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	328,656	40,315			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	581,019	2,002,759			
Contratos Adelantados sobre Euros	-	42,054			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	-	133,753			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	5,558,077	12,135,577			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	2,556,272	3,980,090			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	906,062	1,052,913			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	81,495	87,168			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	7,876,999	10,245,872			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	2,354,528	4,360,991			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	36,706	36,706			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$	1,835,210	\$	2,654,001
Un valor de los activos netos de:	\$	18,342,392	\$	22,084,779
El precio de la acción de:	\$	11.541150	\$	11.142611

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 55-59, 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	4,536,722	8,370,427
Intereses, dividendos, premios y derechos	760,281	833,599
Resultado cambiario / Otros productos	3,331	23,595
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	19,315	(169,437)
INGRESOS NETOS	5,319,649	9,058,184
Costo de ventas de valores	4,071,881	7,816,640
Gastos generales	2,473	4,134
Comisiones sobre saldos	121,491	155,655
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	707	418
EGRESOS NETOS	4,196,553	7,976,847
UTILIDAD DE OPERACIÓN	1,123,096	1,081,336
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(1,125,589)	954,429
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	(2,493)	2,035,766

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