

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

**SIEFORE SURA BASICA 65-69, 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
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	10	11	Acreedores	535,722	316,802
Bancos monedas extranjeras	462,885	36,025	Provisiones para gastos	6,305	16,900
Divisas por recibir	198,586	754,322	Divisas por entregar	410,220	512,771
	661,481	790,358	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	2,152,601	2,588,445
INVERSIONES			TOTAL PASIVO	3,104,849	3,434,917
Inversión en valores de renta variable	19,403,867	13,619,907			
Plus (Minus) valia en valores de renta variable	903,595	1,271,603	CAPITAL CONTABLE	2022	2021
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	31,787,535	25,680,267	CAPITAL		
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	4,513,295	5,119,775	CAPITAL CONTRIBUIDO	91,796,424	84,681,800
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	35,567,359	34,213,878	Capital soc al pagado	97,331,707	91,244,614
Plus (Minus) valia en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(2,067,957)	630,384	Prima en venta de acciones	(5,535,283)	(6,562,814)
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	2,362,713	2,772,060	CAPITAL GANADO	18,867,648	10,436,223
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	166,285	530,662	Resultados de ejercicios anteriores	17,283,144	8,052,653
Inversión en Depósito Banxico	458,193	398,587	Resultados del ejercicio	1,584,504	2,383,571
Plus (Minus) valia en Depósito Banxico	8,765	9,209	OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	1,841,906	1,204,780	PLUS (MINUS) VALÍAS	3,516,439	7,762,224
Plus (Minus) valia instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	(26,319)	125,868	TOTAL CAPITAL CONTABLE	114,180,511	102,880,247
Inversión en FIBRAS	2,912,145	2,767,665			
Plus (Minus) valia en Inversión en FIBRAS	(463,273)	(420,743)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	36,678	3,683			
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	4,924	1			
Inversión en valores extranjeros de deuda	538,724	243,057			
Plus (Minus) valia en Inversión en valores extranjeros de deuda	(9,498)	16,326			
Inversión en títulos Fiduciarios	8,247,710	6,482,010			
Plus (minus) valia en Títulos Fiduciarios	538,503	197,354			
Valores Prestados	0	365,868			
Plus (Minus) valia de valores prestados	-	19,380			
Inversión en Fondos Mutuos	3,498,319	3,505,192			
Plus (Minus) valia de Fondos Mutuos	(46,957)	262,407			
	110,176,514	99,019,180			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	1,054,718	125,505			
Divendos o derechos por cobrar	49	15,410			
Intereses devengados sobre valores	1,153,277	1,000,340			
Reportos	2,749,017	2,997,439			
Premios por cobrar por préstamo de valores	-	10			
Intereses devengados sobre valores prestados	0	9,306			
Reembolsos y otros intereses	120	-			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	1,490,184	2,357,616			
	6,447,365	6,505,626			
TOTAL ACTIVO	117,285,360	106,315,164	TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	117,285,360	106,315,164

CUENTAS DE ORDEN	2022	2021	CUENTAS DE ORDEN	2022	2021
Valores entregados en custodia	110,113,302	98,630,247	Capital social autorizado	35,000,100	35,000,100
Valores prestados	-	385,248	Acciones emitidas	35,000,100,000	35,000,100,000
Garantías recibidas por valores prestados	(0)	410,032	Acciones en circulación, posición propia	49,335,151	51,448,050
Colaterales recibidos por reportos	2,749,597	2,996,291	Acciones de Siefores, posición de terceros	1	1
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	567,435	634,610	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	8,796,837,709	8,241,488,092
Bancos divisas en moneda extranjera	23,306	1,762			
Dólares americanos	23,008	1,762			
Otras Divisas	299	-			
Divisas por recibir	9,974	36,904			
Dólares americanos	9,974	36,904			
Divisas por entregar	20,602	25,087			
Dólares americanos	20,602	25,087			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	4,282,219	5,268,176			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	69,969,192	81,641,601			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	11,841,478	13,311,350			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	7,545,567	12,754,895			
Contratos Adelantados sobre Euros	644,143	4,408,351			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	240,057	1,448,281			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	24,673,867	11,907,816			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	7,725,382	9,953,556			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	1,432,579	1,935,656			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	63,623	63,623			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	11,491,255	10,666,055			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	4,310,266	15,111,754			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	974	80,264			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	65,759,338	74,956,014			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	1,199,481	1,142,326			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	12,254,946	17,801,699			
Contratos Adelantados sobre Euros	1,091,182	4,023,051			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	898,157	1,815,342			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	10,485,100	9,659,900			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	5,481,394	16,282,881			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	1,702,328	1,702,328			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	218,238	390,650			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	24,267,915	11,749,067			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	8,096,974	10,325,148			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	63,623	63,623			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$	3,516,439	\$	7,762,224
Un valor de los activos netos de:	\$	114,180,511	\$	102,880,247
El precio de la acción de:	\$	12.907334	\$	12.405769

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 65-69, 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)

	2022	2021
Ingresos por la venta de Valores	11,163,091	7,936,685
Intereses, dividendos, premios y derechos	1,700,325	1,138,872
Resultado cambiario / Otros productos	(34,693)	(7,309)
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	(341,501)	557,342
INGRESOS NETOS	12,487,222	9,625,590
Costo de ventas de valores	10,736,995	7,016,185
Gastos generales	6,681	6,005
Comisiones sobre saldos	154,509	214,820
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	4,533	5,010
EGRESOS NETOS	10,902,718	7,242,019
UTILIDAD DE OPERACIÓN	1,584,504	2,383,571
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(3,705,042)	(2,663,437)
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	(2,120,538)	(279,866)

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