

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

**SIEFORE SURA BASICA 90-94, 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	11	10	Acreedores	66,366	207,555
Bancos monedas extranjeras	195,942	133,603	Provisiones para gastos	3,704	7,441
Divisas por recibir	138,669	363,371	Divisas por entregar	256,693	472,486
	334,622	496,985	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	1,314,140	1,059,099
RESERVADOS					
Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en pesos	-	8,233			
	-	8,233			
INVERSIONES					
Inversión en valores de renta variable	10,142,213	7,905,422			
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	572,650	733,389	TOTAL PASIVO	1,640,904	1,746,581
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	10,989,780	5,712,071			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	588,673	784,178			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	18,317,977	14,457,441			
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(1,106,290)	83,126			
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	775,727	778,791			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	(3,052)	91,693	CAPITAL CONTABLE		
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	845,831	370,727	CAPITAL		
Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	12,187	31,615	CAPITAL CONTRIBUIDO	42,175,303	34,076,097
Inversión en FIBRAS	1,077,466	926,560	Capital social pagado	41,620,717	34,885,563
Plus (Minus) valía en Inversión en FIBRAS	(126,585)	(114,831)	Prima en venta de acciones	554,587	(809,467)
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	12,164	8			
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	2,496	1	CAPITAL GANADO	8,104,125	4,263,062
Inversión en valores extranjeros de deuda	149,874	34,621	Resultados de ejercicios anteriores	7,730,812	2,800,827
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	(1,971)	3,107	Resultados del ejercicio	373,312	1,462,236
Inversión en títulos Fiduciarios	4,023,742	2,334,624	OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
Plus (minus) valía en Títulos Fiduciarios	262,823	160,238	PLUS (MINUS) VALÍAS	128,324	1,902,005
Inversión en Fondos Mutuos	2,313,387	2,281,314			
Plus (Minus) valía de Fondos Mutuos	(70,111)	129,491			
	48,778,981	36,703,584	TOTAL CAPITAL CONTABLE	50,407,752	40,241,164
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	244,851	47,573			
Dividendos o derechos por cobrar	22	5,065			
Intereses devengados sobre valores	413,955	302,709			
Reportos	1,582,026	2,897,258			
Reembolsos y otros intereses	898	507			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	693,302	1,525,831			
	2,935,053	4,778,942			
TOTAL ACTIVO	52,048,656	41,987,744	TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	52,048,656	41,987,744

CUENTAS DE ORDEN	2022	2021	CUENTAS DE ORDEN	2022	2021
Valores entregados en custodia	48,610,921	36,565,975	Capital social autorizado	35,000,100	35,000,100
Colaterales recibidos por reportos	1,582,360	2,895,268	Acciones emitidas	35,000,100,000	35,000,100,000
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	213,320	773,350	Acciones en circulación, posición propia	18,780,540	17,652,503
Bancos divisas en moneda extranjera	9,880	6,536	Acciones de Siefores, posición de terceros	1	1
Dólares americanos	9,682	6,536	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	3,346,818,429	2,803,318,045
Otras Divisas	198	-			
Divisas por recibir	6,964	17,777			
Dólares americanos	6,964	17,777			
Divisas por entregar	12,892	23,116			
Dólares americanos	12,892	23,116			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	2,074,189	2,713,984			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	40,322,059	40,485,655			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	14,810,294	9,742,632			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	5,396,422	7,868,353			
Contratos Adelantados sobre Euros	487,699	2,131,248			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	540,364	976,825			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	-	108,824			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	8,861,756	6,781,649			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	2,056,099	2,946,349			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	336,393	542,819			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	48,941	48,941			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	5,910,125	5,033,125			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	1,873,471	4,264,208			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	494	40,682			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	25,500,544	33,663,298			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	1,966,989	850,573			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	3,424,750	10,176,239			
Contratos Adelantados sobre Euros	722,221	1,839,135			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	106,392	1,021,568			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	5,300,550	4,423,550			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	2,374,170	4,764,907			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	702,414	702,414			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	62,888	141,493			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	8,614,214	6,627,214			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	2,177,015	3,067,265			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	48,941	48,941			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$ 128,324	\$ 1,902,005
Un valor de los activos netos de:	\$ 50,407,752	\$ 40,241,164
El precio de la acción de:	\$ 14.977349	\$ 14.265007

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 90-94, 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	4,176,467	5,899,782
Intereses, dividendos, premios y derechos	666,962	375,842
Resultado cambiario / Otros productos	(25,954)	744
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	(466,591)	436,866
INGRESOS NETOS	4,350,883	6,713,233
Costo de ventas de valores	3,904,171	5,163,650
Gastos generales	3,556	3,771
Comisiones sobre saldos	66,916	80,860
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	2,928	2,716
EGRESOS NETOS	3,977,571	5,250,997
UTILIDAD DE OPERACIÓN	373,312	1,462,236
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(1,608,311)	(1,120,818)
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	(1,234,999)	341,417

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