

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 2020 Y 2019

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO		2020	2019	PASIVO		2020	2019
DISPONIBLE				OBLIGACIONES			
Bancos moneda nacional		10	10	Acreedores		40,841	33
Bancos monedas extranjeras		14,133	139,573	Provisiones para gastos		774	337
Divisas por recibir		100,302	-	Divisas por entregar		4,139	98,835
		114,445	139,583	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)		1,511,251	691,344
INVERSIONES				TOTAL PASIVO		1,557,004	790,549
Inversión en valores de renta variable		947,265	587,333				
Plus (Minus) valía en valores de renta variable		53,398	31,690				
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís		7,729,736	5,111,092				
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís		1,946,375	941,090				
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos		7,333,286	3,150,044				
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos		511,372	70,236				
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso		525,764	269,327				
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso		98,950	68,488				
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas		740,840	390,935				
Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas		83,963	18,721				
Inversión en FIBRAS		578,311	69,293				
Plus (Minus) valía en Inversion en FIBRAS		(169,958)	3,294				
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados		-	4,956				
Inversión en valores extranjeros de deuda		141,591	139,537				
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda		33,520	21,168				
Valores Prestados		448,231	360,742				
Plus (Minus) valía de valores prestados		73,208	8,307				
Inversión en Fondos Mutuos		152,686	-				
Plus (Minus) valía de Fondos Mutuos		23,172	-				
		21,251,711	11,246,251				
DEUDORES DIVERSOS							
Liquidadora		87,198	99,137				
Dividendos o derechos por cobrar		1,236	46				
Intereses devengados sobre valores		231,184	140,198				
Reportos		783,242	286,538				
Premios por cobrar por préstamo de valores		2	12				
Intereses devengados sobre valores prestados		7,210	1,478				
Reembolsos y otros intereses		929	-				
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)		1,164,626	593,166				
		2,275,627	1,120,573				
TOTAL ACTIVO		23,641,783	12,506,407				
				CAPITAL CONTABLE		2020	2019
				CAPITAL			
				CAPITAL CONTRIBUIDO		6,788,494	(738,286)
				Capital social pagado		7,032,788	4,141,845
				Prima en venta de acciones		(244,294)	(4,880,130)
				CAPITAL GANADO		12,642,284	11,291,152
				Resultados de ejercicios anteriores		11,560,947	10,569,101
				Resultados del ejercicio		1,081,336	722,051
				OTROS RESULTADOS INTEGRALES			
				PLUS (MINUS) VALÍAS		2,654,001	1,162,992
				TOTAL CAPITAL CONTABLE		22,084,779	11,715,858
				TOTAL PASIVO MAS CAPITAL		23,641,783	12,506,407

CUENTAS DE ORDEN	2020	2019	CUENTAS DE ORDEN	2020	2019
Valores entregados en custodia	20,466,672	10,746,246	Capital social autorizado	11,354,689	11,354,689
Valores prestados	521,440	369,049	Acciones emitidas	3,200,028,183	3,200,028,183
Garantías recibidas por valores prestados	558,590	385,078	Acciones en circulación, posición propia	13,193,112	9,173,115
Colaterales recibidos por reportos	783,512	-	Acciones de Siefores, posición de terceros	1,127	1,127
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	247,395	138,883	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	1,968,816,822	1,158,098,546
Bancos divisas en moneda extranjera	5,714	12,214			
Dólares americanos	590	6,249			
Euros	-	711			
Yenes	5,125	5,255			
Divisas por recibir	4,530	-			
Dólares americanos	4,530	-			
Divisas por entregar	187	5,008			
Dólares americanos	187	5,008			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	35,340,348	29,608,249			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	502,051	173,856			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	2,336,626	1,531,387			
Contratos Adelantados sobre Euros	423,568	101,809			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	206,615	196,870			
Contratos de Opciones sobre Renta Variable Nacional	52	52			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	9,542,427	9,433,184			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	4,263,141	2,814,620			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	1,226,684	957,346			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	36,706	307,722			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	13,186,672	11,737,948			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	3,611,084	2,064,531			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	-	288,924			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	4,722	-			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	34,118,198	28,694,424			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	40,315	103,410			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	2,002,759	899,708			
Contratos Adelantados sobre Euros	42,054	38,520			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	133,753	-			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	-	43,461			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	12,135,577	10,714,611			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	3,980,090	2,383,216			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	1,052,913	1,052,913			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	87,168	376,092			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	10,245,872	9,890,299			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	4,360,991	2,884,470			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	36,706	307,722			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$	2,654,001	\$	1,162,992
Un valor de los activos netos de:	\$	22,084,779	\$	11,715,858
El precio de la acción de:	\$	11.142611	\$	10.036950

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**

ESTADO DE RESULTADOS INTEGRAL POR LOS PERIODOS DEL 1 DE ENERO AL 30 DE SEPTIEMBRE DE 2020 Y 2019

(Cifras en miles de pesos)

	2020	2019
Ingresos por la venta de Valores	8,370,427	5,257,721
Intereses, dividendos, premios y derechos	833,599	480,269
Resultado cambiario / Otros productos	23,595	2,603
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	(169,437)	(27,569)
INGRESOS NETOS	9,058,184	5,713,024
Costo de ventas de valores	7,816,640	4,891,807
Gastos generales	4,134	10,192
Comisiones sobre saldos	155,655	88,974
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	418	-
EGRESOS NETOS	7,976,847	4,990,973
UTILIDAD DE OPERACIÓN	1,081,336	722,051
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	954,429	460,426
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	2,035,766	1,182,477