

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

**SIEFORE SURA BASICA 75-79, 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		277,519	569,152
Bancos monedas extranjeras		57,416	584,395	Provisiones para gastos		7,044	11,315
Divisas por recibir		98,831	-	Divisas por entregar		93,163	453,894
		156,257	584,405	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)		8,759,046	6,237,942
INVERSIONES				TOTAL PASIVO		9,136,772	7,272,302
Inversión en valores de renta variable		19,323,163	18,011,023				
Plus (Minus) valía en valores de renta variable		382,637	183,433				
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís		28,221,374	60,271,552				
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís		5,740,226	7,239,247				
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos		31,796,671	58,771,323				
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos		2,093,339	1,235,773				
Inversiones Tercerizadas		-	3,488,726				
Plus (Minus) valía en inversiones tercerizadas		-	933,827				
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso		3,212,787	4,653,166				
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso		590,902	738,125				
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas		3,113,394	2,004,379				
Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas		404,167	77,475				
Inversión en FIBRAS		3,571,339	6,630,579				
Plus (Minus) valía en Inversion en FIBRAS		(940,601)	(678,718)				
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados		1,347	14,805				
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)		1	-				
Inversión en valores extranjeros de deuda		231,512	411,028				
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda		23,526	10,952				
Inversión en títulos Fiduciarios		8,109,084	12,353,381				
Plus (minus) valía en Títulos Fiduciarios		372,961	2,150,508				
Valores Prestados		1,234,168	1,728,607				
Plus (Minus) valía de valores prestados		156,343	84,636				
Inversión en Fondos Mutuos		3,768,206	-				
Plus (Minus) valía de Fondos Mutuos		406,901	-				
		111,813,451	180,313,827				
DEUDORES DIVERSOS							
Inversiones Tercerizadas en Tránsito		-	-				
Liquidadora		537,381	454,247				
Dividendos o derechos por cobrar		12,500	2,154				
Intereses devengados sobre valores		984,415	1,862,985				
Reportos		5,151,984	3,417,113				
Premios por cobrar por préstamo de valores		11	34				
Intereses devengados sobre valores prestados		11,630	8,675				
Reembolsos y otros intereses		483	-				
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)		7,853,539	5,614,493				
		14,551,943	11,359,701				
TOTAL ACTIVO		126,521,651	192,257,934				
				CAPITAL CONTABLE		2020	2019
				CAPITAL			
				CAPITAL CONTRIBUIDO		27,802,295	102,750,549
				Capital social pagado		47,658,044	82,676,705
				Prima en venta de acciones		(19,855,749)	20,073,844
				CAPITAL GANADO		80,352,181	70,259,825
				Resultados de ejercicios anteriores		75,690,810	59,908,016
				Resultados del ejercicio		4,661,371	10,351,809
				OTROS RESULTADOS INTEGRALES			
				PLUS (MINUS) VALÍAS		9,230,403	11,975,258
				TOTAL CAPITAL CONTABLE		117,384,879	184,985,632
				TOTAL PASIVO MAS CAPITAL		126,521,651	192,257,934

CUENTAS DE ORDEN	2020	2019	CUENTAS DE ORDEN	2020	2019
Valores entregados en custodia	110,421,591	178,180,579	Capital social autorizado	126,259,200	126,259,200
Valores prestados	1,390,511	1,813,243	Acciones emitidas	25,000,019,801	25,000,019,801
Garantías recibidas por valores prestados	1,469,104	1,908,619	Acciones en circulación, posición propia	62,229,419	121,523,740
Colaterales recibidos por reportos	5,148,867	-	Acciones de Siefores, posición de terceros	2	2
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	1,126,368	819,429	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	9,374,326,782	16,248,921,091
Bancos divisas en moneda extranjera	55,330	52,119			
Dólares americanos	2,088	26,840			
Euros	-	2,349			
Yenes	53,242	22,930			
Divisas por recibir	4,463	-			
Dólares americanos	4,463	-			
Divisas por entregar	4,207	23,000			
Dólares americanos	4,207	23,000			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	9,574,976	11,619,020			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	314,824,027	325,182,199			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	15,167,261	17,242,851			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	15,223,780	18,916,037			
Contratos Adelantados sobre Euros	4,177,141	3,711,916			
Contratos de Opciones sobre Renta Variable Nacional	2,803	2,803			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	89,626,261	97,269,380			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	42,281,374	40,739,454			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	5,356,623	3,283,547			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	249,598	3,023,005			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	107,006,713	107,398,810			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	35,591,801	30,642,609			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	-	2,951,785			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	140,672	-			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	302,935,594	309,214,455			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	890,820	5,854,305			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	17,852,758	16,538,632			
Contratos Adelantados sobre Euros	903,812	625,183			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	2,541,495	-			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	-	327,933			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	335,543	369,824			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	102,209,734	102,631,815			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	37,629,553	34,461,688			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	4,030,361	5,142,344			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	458,911	3,694,375			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	92,406,608	94,867,631			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	43,426,402	41,677,720			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	249,598	3,023,005			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$	9,230,403	\$	11,975,258
Un valor de los activos netos de:	\$	117,384,879	\$	184,985,632
El precio de la acción de:	\$	12.439377	\$	11.299976

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 75-79, 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	34,315,136	39,545,713
Intereses, dividendos, premios y derechos	4,018,896	7,389,743
Resultado cambiario / Otros productos	150,923	708
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	(1,070,417)	2,941,069
INGRESOS NETOS	37,414,538	49,877,232
Costo de ventas de valores	31,964,119	38,091,779
Gastos generales	33,528	154,830
Comisiones sobre saldos	747,423	1,261,981
Comisiones por servicios de tercerización	-	16,833
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	8,096	-
EGRESOS NETOS	32,753,166	39,525,424
UTILIDAD DE OPERACIÓN	4,661,371	10,351,809
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	3,388,889	9,948,800
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	8,050,260	20,300,608

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.