

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

**SIEFORE SURA BASICA 80-84, 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	-	Acreedores		239,803	-
Bancos monedas extranjeras		41,986	-	Provisiones para gastos		6,445	-
Divisas por recibir		90,330	-	Divisas por entregar		91,547	-
		132,325	-	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)		2,646,363	-
INVERSIONES				TOTAL PASIVO		2,984,158	-
Inversión en valores de renta variable		18,258,405	-				
Plus (Minus) valía en valores de renta variable		411,791	-				
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís		22,112,206	-				
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís		4,147,893	-				
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos		26,586,356	-				
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos		1,852,663	-				
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso		2,645,163	-				
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso		388,507	-				
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas		1,688,260	-				
Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas		170,514	-				
Inversión en FIBRAS		2,913,122	-				
Plus (Minus) valía en Inversión en FIBRAS		(733,447)	-				
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados		2,173	-				
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)		1	-				
Inversión en valores extranjeros de deuda		127,188	-				
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda		13,635	-				
Inversión en títulos Fiduciarios		6,539,502	-				
Plus (minus) valía en Títulos Fiduciarios		444,827	-				
Valores Prestados		1,196,388	-				
Plus (Minus) valía de valores prestados		156,172	-				
Inversión en Fondos Mutuos		3,686,041	-				
Plus (Minus) valía de Fondos Mutuos		406,372	-				
		93,013,732	-				
DEUDORES DIVERSOS							
Liquidadora		451,655	-				
Dividendos o derechos por cobrar		11,640	-				
Intereses devengados sobre valores		762,655	-				
Reportos		3,247,346	-				
Premios por cobrar por préstamo de valores		11	-				
Intereses devengados sobre valores prestados		13,626	-				
Reembolsos y otros intereses		1,518	-				
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)		2,867,991	-				
		7,356,442	-				
TOTAL ACTIVO		100,502,500	-				
				CAPITAL CONTABLE		2020	2019
				CAPITAL			
				CAPITAL CONTRIBUIDO		86,810,370	-
				Capital social pagado		91,666,000	-
				Prima en venta de acciones		(4,855,629)	-
				CAPITAL GANADO		3,449,046	-
				Resultados de ejercicios anteriores		458,674	-
				Resultados del ejercicio		2,990,372	-
				OTROS RESULTADOS INTEGRALES			
				PLUS (MINUS) VALÍAS		7,258,926	-
				TOTAL CAPITAL CONTABLE		97,518,343	-
				TOTAL PASIVO MAS CAPITAL		100,502,500	-

CUENTAS DE ORDEN	2020	2019	CUENTAS DE ORDEN	2020	2019
Valores entregados en custodia	91,352,598	-	Capital social autorizado	35,000,100	-
Valores prestados	1,352,560	-	Acciones emitidas	35,000,100,000	-
Garantías recibidas por valores prestados	1,434,567	-	Acciones en circulación, posición propia	58,864,761	-
Colaterales recibidos por reportos	3,247,639	-	Acciones de Siefores, posición de terceros	1	-
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	1,424,160	-	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	9,107,735,206	-
Bancos divisas en moneda extranjera	1,896	-			
Dólares americanos	1,896	-			
Divisas por recibir	4,079	-			
Dólares americanos	4,079	-			
Divisas por entregar	4,134	-			
Dólares americanos	4,134	-			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	8,558,495	-			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	62,126,469	-			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	15,184,956	-			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	11,942,748	-			
Contratos Adelantados sobre Euros	3,956,992	-			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	434,655	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	4,554,531	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	7,949,705	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	1,924,803	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	161,504	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	8,502,097	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	7,377,081	-			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	137,394	-			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	53,317,367	-			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	958,853	-			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	18,265,798	-			
Contratos Adelantados sobre Euros	805,343	-			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	2,540,007	-			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	39,733	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	7,446,500	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	8,700,352	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	1,416,521	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	384,415	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	4,441,874	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	8,156,467	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	161,504	-			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$	7,258,926	\$	-
Un valor de los activos netos de:	\$	97,518,343	\$	-
El precio de la acción de:	\$	10.638442	\$	-

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 80-84, 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	30,502,257	-
Intereses, dividendos, premios y derechos	3,216,347	-
Resultado cambiario / Otros productos	109,024	-
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	(1,327,889)	-
INGRESOS NETOS	32,499,740	-
Costo de ventas de valores	28,866,597	-
Gastos generales	22,551	-
Comisiones sobre saldos	612,080	-
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	8,140	-
EGRESOS NETOS	29,509,367	-
UTILIDAD DE OPERACIÓN	2,990,372	-
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	3,237,924	-
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	6,228,297	-

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.