

**COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO**

**SIEFORE SURA BASICA 60-64, 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 JUNIO DE 2020 Y 2019**

(Cifras en miles de pesos)

<b>ACTIVO</b>	<b>2020</b>	<b>2019</b>	<b>PASIVO</b>	<b>2020</b>	<b>2019</b>
<b>DISPONIBLE</b>			<b>OBLIGACIONES</b>		
Bancos moneda nacional	11	1,498	Acreedores	437,841	877,002
Bancos monedas extranjeras	34,939	49,332	Provisiones para gastos	3,323	23,171
Divisas por recibir	404,620	126,579	Divisas por entregar	393,465	123,235
	<b>439,570</b>	<b>177,409</b>	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	9,554,523	5,851,811
<b>RESERVADOS</b>			<b>TOTAL PASIVO</b>	<b>10,389,152</b>	<b>6,875,219</b>
Bancos Moneda Nal., Depósitos reserv. al pago compromisos futuros en pesos	-	15,768			
Bancos Moneda Extr., Depósitos reserv. al pago compromisos futuros en divisas	4,863	-			
	<b>4,863</b>	<b>15,768</b>			
<b>INVERSIONES</b>			<b>CAPITAL CONTABLE</b>	<b>2020</b>	<b>2019</b>
Inversión en valores de renta variable	8,636,885	23,490,747	<b>CAPITAL</b>		
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	375,624	965,394	<b>CAPITAL CONTRIBUIDO</b>		
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	20,595,668	76,805,654	Capital social pagado	6,344,722	20,424,386
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	3,973,098	8,525,518	Prima en venta de acciones	(67,675,300)	63,222,937
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	22,655,886	58,028,789	<b>CAPITAL GANADO</b>	<b>127,756,361</b>	<b>117,530,046</b>
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	1,644,153	(636,029)	Resultados de ejercicios anteriores	127,429,042	110,415,764
Inversiones Tercerizadas	-	3,250,938	Resultados del ejercicio	327,319	7,114,282
Plus (Minus) valía en inversiones tercerizadas	-	734,078	<b>OTROS RESULTADOS INTEGRALES</b>		
Inversión en instrum. deuda nacional en divisas distintas al peso	2,128,098	7,922,760	PLUS (MINUS) VALÍAS	6,895,783	11,823,261
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	518,747	739,800			
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	3,123,089	2,832,047			
Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	367,647	28,555			
Inversión en FIBRAS	1,789,073	6,493,025			
Plus (Minus) valía en Inversion en FIBRAS	(525,753)	(1,296,189)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	-	2,918			
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	19	-			
Inversión en valores extranjeros de deuda	145,426	518,916			
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	18,102	60			
Inversión en títulos Fiduciarios	2,915,051	10,432,163			
Plus (minus) valía en Títulos Fiduciarios	319,660	2,162,605			
Valores Prestados	290,626	7,846,089			
Plus (Minus) valía de valores prestados	21,326	599,469			
Inversión en Fondos Mutuos	1,119,685	-			
Plus (Minus) valía de Fondos Mutuos	183,180	-			
	<b>70,295,290</b>	<b>209,447,306</b>			
<b>DEUDORES DIVERSOS</b>					
Liquidadora	6,507	21,928			
Dividendos o derechos por cobrar	60	-			
Intereses devengados sobre valores	478,037	1,155,565			
Reportos	4,290,246	4,167,473			
Premios por cobrar por préstamo de valores	5	653			
Intereses devengados sobre valores prestados	685	125,247			
Reembolsos y otros intereses	131	-			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	8,195,326	4,764,499			
	<b>12,970,997</b>	<b>10,235,365</b>			
<b>TOTAL ACTIVO</b>	<b>83,710,720</b>	<b>219,875,848</b>	<b>TOTAL PASIVO MAS CAPITAL</b>	<b>83,710,720</b>	<b>219,875,848</b>

CUENTAS DE ORDEN	2020	2019	CUENTAS DE ORDEN	2020	2019
Valores entregados en custodia	69,983,318	200,498,630	Capital social autorizado	27,500,100	27,500,100
Valores prestados	311,952	8,445,558	Acciones emitidas	27,500,100,000	27,500,100,000
Garantías recibidas por valores prestados	336,803	8,976,027	Acciones en circulación, posición propia	41,879,649	151,659,527
Colaterales recibidos por reportos	4,283,884	-	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	6,302,842,768	20,272,726,496
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	854,248	739,551			
Bancos divisas en moneda extranjera	57,087	19,074			
Dólares americanos	993	1,911			
Euros	-	441			
Yenes	56,093	16,721			
Divisas por recibir	17,524	6,579			
Dólares americanos	17,524	6,500			
Euros	-	79			
Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en moneda extranjera	211	-			
Dólares americanos	211	-			
Divisas por entregar	17,041	6,416			
Dólares americanos	17,041	6,416			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	3,138,977	10,900,450			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	287,903,934	337,416,507			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	5,050,410	13,660,553			
Contratos Adelantados sobre Tasa Fija en Dólar Americano	12,553,097	24,796,831			
Contratos Adelantados sobre Euros	2,127,948	2,598,474			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Extranjera	-	52,252			
Contratos de Opciones sobre Renta Variable Nacional	-	3,101			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	88,259,992	94,872,225			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	38,396,324	40,806,520			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	4,124,535	3,250,080			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	337,691	3,454,436			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	101,760,138	110,520,793			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	35,233,316	40,082,920			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	-	3,318,322			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	60,483	-			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	278,829,284	322,375,863			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	157,470	3,652,318			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	8,858,753	20,550,276			
Contratos Adelantados sobre Euros	778,343	370,096			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	538,343	-			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	-	1,035,362			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	320,253	309,853			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	97,971,709	105,596,904			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	36,770,009	44,309,189			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	3,212,648	5,049,284			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	518,978	4,296,034			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	90,039,383	92,016,209			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	39,325,705	41,735,902			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	337,691	3,454,436			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valla de:	\$	6,895,783	\$	11,823,261
Un valor de los activos netos de:	\$	73,321,568	\$	213,000,629
El precio de la acción de:	\$	11.556308	\$	10.428741

**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 60-64, 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 JUNIO DE 2020 Y 2019**

(Cifras en miles de pesos)

	<b>2020</b>	<b>2019</b>
Ingresos por la venta de Valores	14,432,926	18,246,312
Intereses, dividendos, premios y derechos	1,835,615	5,685,523
Resultado cambiario / Otros productos	24,508	(66,850)
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	(1,466,182)	2,209,357
<b>INGRESOS NETOS</b>	<b>14,826,867</b>	<b>26,074,342</b>
Costo de ventas de valores	14,162,822	17,861,960
Gastos generales	17,305	91,120
Comisiones sobre saldos	317,391	996,859
Comisiones por servicios de tercerización	-	10,120
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	2,030	-
<b>EGRESOS NETOS</b>	<b>14,499,548</b>	<b>18,960,060</b>
<b>UTILIDAD DE OPERACIÓN</b>	<b>327,319</b>	<b>7,114,282</b>
<b>OTROS RESULTADOS INTEGRALES</b>		
PLUS (MINUS) VALÍAS	3,181,323	10,118,247
<b>UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO</b>	<b>3,508,642</b>	<b>17,232,530</b>

\_\_\_\_\_  
**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 6 de Mayo de 2020 fueron aprobados los Estados Financieros al 31 de Marzo de 2020, Así mismo los presentes Estados Financieros al 30 de Junio del 2020 serán aprobados en la sesión del Consejo de Administración con fecha 24 de Julio 2020