

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

**SIEFORE SURA BASICA 85-89, 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)

ACTIVO	2020	2019	PASIVO	2020	2019
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	10	662	Acreedores	667,285	1,679,660
Bancos monedas extranjeras	37,761	16,889	Provisiones para gastos	3,475	16,095
Divisas por recibir	620,165	890,108	Divisas por entregar	611,548	883,132
	657,936	907,658	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	8,255,481	4,915,355
RESERVADOS			TOTAL PASIVO	9,537,789	7,494,241
Bancos Moneda Nal., Depósitos reserv. al pago compromisos futuros en pesos	-	15,463			
Bancos Moneda Extr., Depósitos reserv. al pago compromisos futuros en divisas	3,234	-			
	3,234	15,463			
INVERSIONES			CAPITAL CONTABLE	2020	2019
Inversión en valores de renta variable	11,651,330	19,170,942	CAPITAL		
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	475,168	272,969	CAPITAL CONTRIBUIDO		
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	13,112,034	39,609,836	Capital social pagado	24,510,436	56,921,357
Plus(Minus) valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	2,297,758	3,538,935	Prima en venta de acciones	(26,809,114)	15,980,809
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	18,322,121	33,911,454	CAPITAL GANADO	59,778,290	53,396,780
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	1,477,438	(129,492)	Resultados de ejercicios anteriores	59,885,630	48,079,485
Inversiones Tercerizadas	-	3,064,120	Resultados del ejercicio	(107,340)	5,317,295
Plus (Minus) valía en inversiones tercerizadas	-	697,886	OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	1,683,148	4,305,301	PLUS (MINUS) VALÍAS	4,840,595	5,695,133
Plus(Minus) valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	263,750	294,484	TOTAL CAPITAL CONTABLE	62,320,207	131,994,078
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	1,861,233	1,467,989			
Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	203,382	9,156			
Inversión en FIBRAS	1,757,054	3,953,484			
Plus (Minus) valía en Inversion en FIBRAS	(467,894)	(730,436)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	-	2,593			
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	28	-			
Inversión en valores extranjeros de deuda	64,945	170,717			
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	6,996	1,059			
Inversión en títulos Fiduciarios	4,041,424	7,246,717			
Plus (minus) valía en Títulos Fiduciarios	236,855	1,350,185			
Valores Prestados	619,487	5,186,880			
Plus (Minus) valía de valores prestados	101,953	390,387			
Inversión en Fondos Mutuos	1,508,934	-			
Plus (Minus) valía de Fondos Mutuos	245,189	-			
	59,462,333	123,785,167			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	10,229	10,690			
Dividendos o derechos por cobrar	87	-			
Intereses devengados sobre valores	373,115	661,715			
Reportos	3,683,743	9,248,350			
Premios por cobrar por préstamo de valores	14	480			
Intereses devengados sobre valores prestados	1,497	69,001			
Reembolsos y otros intereses	180	-			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	7,665,628	4,789,795			
	11,734,493	14,780,031			
TOTAL ACTIVO	71,857,995	139,488,319	TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	71,857,995	139,488,319

CUENTAS DE ORDEN	2020	2019	CUENTAS DE ORDEN	2020	2019
Valores entregados en custodia	58,740,865	118,017,506	Capital social autorizado	126,259,200	126,259,200
Valores prestados	721,440	5,577,268	Acciones emitidas	25,000,019,801	25,000,019,801
Garantías recibidas por valores prestados	752,766	5,914,759	Acciones en circulación, posición propia	31,781,760	84,972,341
Colaterales recibidos por reportos	3,678,375	-	Acciones de Siefores, posición de terceros	2	2
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	691,342	692,171	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	4,821,420,095	11,185,771,025
Bancos divisas en moneda extranjera	60,316	13,320			
Dólares americanos	1,087	540			
Euros	-	196			
Yenes	59,229	12,584			
Divisas por recibir	26,859	46,298			
Dólares americanos	26,859	46,000			
Euros	-	298			
Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en moneda extranjera	140	-			
Dólares americanos	140	-			
Divisas por entregar	26,486	45,976			
Dólares americanos	26,486	45,976			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	6,050,335	9,458,999			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	222,330,411	261,258,667			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	8,923,312	13,092,071			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	9,750,558	15,529,294			
Contratos Adelantados sobre Euros	2,527,810	2,072,874			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	275,876	1,374,939			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Extranjera	-	46,446			
Contratos de Opciones sobre Renta Variable Nacional	-	1,990			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	72,430,823	82,456,495			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	28,025,577	30,073,815			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	3,579,989	4,193,871			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	119,905	1,957,562			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	73,564,109	84,646,969			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	23,044,757	23,960,575			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	-	1,851,766			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	87,696	-			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	213,988,769	249,470,789			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	224,260	3,073,653			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	11,024,202	16,523,909			
Contratos Adelantados sobre Euros	796,455	296,523			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	845,798	-			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	442,719	391,108			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	72,058,503	81,689,250			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	23,657,718	26,873,028			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	3,061,883	4,493,553			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	266,202	2,509,034			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	72,641,216	80,765,024			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	28,849,908	30,898,145			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	119,905	1,957,562			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$	4,840,595	\$	5,695,133
Un valor de los activos netos de:	\$	62,320,207	\$	131,994,078
El precio de la acción de:	\$	12.841050	\$	11.711213

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 85-89, 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)

	2020	2019
Ingresos por la venta de Valores	12,976,017	11,474,876
Intereses, dividendos, premios y derechos	1,427,577	3,387,205
Resultado cambiario / Otros productos	23,046	(15,049)
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	(1,325,258)	2,615,339
INGRESOS NETOS	13,101,382	17,462,371
Costo de ventas de valores	12,929,311	11,469,171
Gastos generales	16,152	72,013
Comisiones sobre saldos	260,528	594,354
Comisiones por servicios de tercerización	-	9,538
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	2,730	-
EGRESOS NETOS	13,208,722	12,145,076
UTILIDAD DE OPERACIÓN	(107,340)	5,317,295
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	2,514,545	6,335,619
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	2,407,205	11,652,914

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