

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

**SIEFORE SURA BASICA 55-59 S.A. DE C.V. (ANTES: SIEFORE SURA BÁSICA 1, 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 2019 Y 2018**

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2019	2018	PASIVO	2019	2018
<b>DISPONIBLE</b>			<b>OBLIGACIONES</b>		
Bancos moneda nacional	10	10	Acreedores	33	17
Bancos monedas extranjeras	139,573	15,481	Provisiones para gastos	337	888
	<b>139,583</b>	<b>15,492</b>	Divisas por entregar	98,835	-
<b>INVERSIONES</b>			Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	691,344	935,291
Inversión en valores de renta variable	587,333	595,657			
Plus (Minus) valia en valores de renta variable	31,690	64,651	<b>TOTAL PASIVO</b>	<b>790,549</b>	<b>936,197</b>
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	5,111,092	5,619,011			
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	941,090	796,662			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	3,150,044	2,079,895			
Plus (Minus) valia en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	70,236	(75,946)	<b>CAPITAL CONTABLE</b>	<b>2019</b>	<b>2018</b>
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	269,327	436,664	<b>CAPITAL</b>		
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	68,488	60,520	<b>CAPITAL CONTRIBUIDO</b>		
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	390,935	354,910	Capital social pagado	(738,286)	(1,025,371)
Plus (Minus) valia instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	18,721	9,677	Prima en venta de acciones	4,141,845	3,964,180
Inversión en FIBRAS	69,293	2,759		(4,880,130)	(4,989,551)
Plus (Minus) valia en Inversión en FIBRAS	3,294	(54)	<b>CAPITAL GANADO</b>	<b>11,291,152</b>	<b>10,359,947</b>
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	4,956	1,293	Resultados de ejercicios anteriores	10,569,101	9,871,107
Inversión en valores extranjeros de deuda	139,537	164,120	Resultados del ejercicio	722,051	488,841
Plus (Minus) valia en Inversión en valores extranjeros de deuda	21,168	23,671	<b>OTROS RESULTADOS INTEGRALES</b>		
Inversión en instrumentos de deuda por reporto	286,206	49,134	PLUS (MINUS) VALÍAS	1,162,992	880,519
Plus (Minus) valia de valores por reporto	34	115			
Valores Prestados	360,742	137,441	<b>TOTAL CAPITAL CONTABLE</b>	<b>11,715,858</b>	<b>10,215,095</b>
Plus (Minus) valia de valores prestados	8,307	1,338			
	<b>11,532,491</b>	<b>10,321,518</b>			
<b>DEUDORES DIVERSOS</b>					
Liquidadora	99,137	814			
Dividendos o derechos por cobrar	46	77			
Intereses devengados sobre valores	140,198	112,427			
Reportos	(24)	(115)			
Premios por cobrar por préstamo de valores	12	5			
Intereses devengados por instrumentos recibidos en reporto	322	193			
Intereses devengados sobre valores prestados	1,478	2,556			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	593,166	698,326			
	<b>834,333</b>	<b>814,282</b>			
<b>TOTAL ACTIVO</b>	<b>12,506,407</b>	<b>11,151,291</b>	<b>TOTAL PASIVO MAS CAPITAL</b>	<b>12,506,407</b>	<b>11,151,291</b>

CUENTAS DE ORDEN	2019	2018	CUENTAS DE ORDEN	2019	2018
Valores entregados en custodia	10,746,246	9,993,796	Capital social autorizado	11,354,689	11,354,689
Valores entregados en custodia por reporto	286,538	49,326	Acciones emitidas	3,200,028,183	3,200,028,183
Valores prestados	369,049	138,779	Acciones en circulación, posición propia	9,173,115	8,218,996
Garantías recibidas por préstamo de valores	385,078	149,767	Acciones de Siefores, posición de terceros	1,127	1,127
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	138,883	63,161	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	1,158,098,546	1,108,982,378
<b>Bancos divisas en moneda extranjera</b>	<b>12,214</b>	<b>1,173</b>			
Dólares americanos	6,249	329			
Euros	711	426			
Yenes	5,255	419			
<b>Divisas por entregar</b>	<b>5,008</b>	-			
Dólares americanos	5,008	-			
<b>Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga</b>	<b>29,608,249</b>	<b>27,986,799</b>			
Forwards sobre Renta Variable Extranjera	173,856	162,332			
Forwards sobre Dólar Americano	1,531,387	1,524,613			
Forwards sobre Euros	101,809	99,991			
Forwards sobre Otras Divisas	-	38,255			
Futuros sobre Dólar Americano	196,870	-			
Opciones sobre Renta Variable Nacional	52	65			
Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	9,433,184	9,410,757			
Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	2,814,620	2,300,733			
Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	957,346	1,085,336			
Swaps sobre Tasa Fija en Euros	307,722	173,098			
Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	11,737,948	11,118,806			
Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	2,064,531	1,783,891			
Swaps sobre Tasa Variable en Euros	288,924	288,924			
<b>Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta</b>	<b>28,694,424</b>	<b>27,253,743</b>			
Forwards sobre Renta Variable Extranjera	103,410	96,507			
Forwards sobre Dólar Americano	899,708	845,929			
Forwards sobre Euros	38,520	20,532			
Forwards sobre Otras Divisas	-	38,352			
Futuros sobre Renta Variable Nacional	43,461	48,883			
Futuros sobre Dólar Americano	-	42,356			
Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	10,714,611	9,923,177			
Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	2,383,216	2,011,354			
Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	1,052,913	1,242,749			
Swaps sobre Tasa Fija en Euros	376,092	363,949			
Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	9,890,299	9,974,148			
Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	2,884,470	2,472,709			
Swaps sobre Tasa Variable en Euros	307,722	173,098			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$ 1,162,992	\$ 880,519
Un valor de los activos netos de:	\$ 11,715,858	\$ 10,215,095
El precio de la acción de:	\$ 10.036950	\$ 9.143459

**GABRIEL VILLAGÓMEZ GÓMEZ**  
Contador General de SIEFORE

**LUIS ARMANDO KURI HENAINE**  
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. (ANTES: SIEFORE SURA BÁSICA 1, 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 30 DE SEPTIEMBRE DE 2019 Y 2018**

(Cifras en miles de pesos)

	<b>2019</b>	<b>2018</b>
Ingresos por la venta de Valores	5,257,721	2,882,104
Intereses, dividendos, premios y derechos	488,889	420,112
Resultado cambiario / Otros productos	2,603	(11,293)
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	(27,569)	118,366
<b>INGRESOS NETOS</b>	<b>5,721,645</b>	<b>3,409,289</b>
Costo de ventas de valores	4,891,807	2,820,605
Gastos generales	10,192	6,323
Comisiones sobre saldos	88,974	83,858
Comisiones por servicios de tercerización	-	-
Intereses sobre inversiones en valores a entregar	8,621	9,662
<b>EGRESOS NETOS</b>	<b>4,999,593</b>	<b>2,920,448</b>
<b>UTILIDAD DE OPERACIÓN</b>	<b>722,051</b>	<b>488,841</b>
<b>OTROS RESULTADOS INTEGRALES</b>		
PLUS (MINUS) VALÍAS	460,426	866
<b>UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO</b>	<b>1,182,477</b>	<b>489,707</b>

\_\_\_\_\_  
**GABRIEL VILLAGÓMEZ GÓMEZ**  
Contador General de SIEFORE

\_\_\_\_\_  
**LUIS ARMANDO KURI HENAINE**  
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.

**NOTA A LOS ESTADOS FINANCIEROS**

En la Sesión del Consejo de Administración con fecha 14 de Agosto de 2019 fueron aprobados los Estados Financieros al 28 de Junio de 2019, Así mismo los presentes Estados Financieros al 30 de Septiembre del 2019 seran aprobados en la sesión del Consejo de Administración con fecha 13 de Noviembre 2019.