

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 |
|---|-------------------|-------------------|---|-------------------|--------------------|
| | | | | 2019 | 2018 |
| DISPONIBLE | | | OBLIGACIONES | | |
| Bancos moneda nacional | 10 | 10 | Acreedores | 33 | 17 |
| Bancos monedas extranjeras | 139,573 | 15,481 | Provisiones para gastos | 337 | 888 |
| | 139,583 | 15,492 | Divisas por entregar | 98,835 | - |
| INVERSIONES | | | 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 | TOTAL PASIVO | 790,549 | 936,197 |
| 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) | CAPITAL CONTABLE | 2019 | 2018 |
| Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso | 269,327 | 436,664 | CAPITAL | | |
| Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso | 68,488 | 60,520 | CAPITAL CONTRIBUIDO | (738,286) | (1,025,371) |
| Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas | 390,935 | 354,910 | Capital social pagado | 4,141,845 | 3,964,180 |
| Plus (Minus) valia instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas | 18,721 | 9,677 | Prima en venta de acciones | (4,880,130) | (4,989,551) |
| Inversión en FIBRAS | 69,293 | 2,759 | | | |
| Plus (Minus) valia en Inversión en FIBRAS | 3,294 | (54) | CAPITAL GANADO | 11,291,152 | 10,359,947 |
| 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 | | | |
| Inversión en instrumentos de deuda por reporto | 286,206 | 49,134 | OTROS RESULTADOS INTEGRALES | | |
| Plus (Minus) valia de valores por reporto | 34 | 115 | PLUS (MINUS) VALÍAS | 1,162,992 | 880,519 |
| Valores Prestados | 360,742 | 137,441 | | | |
| Plus (Minus) valia de valores prestados | 8,307 | 1,338 | TOTAL CAPITAL CONTABLE | 11,715,858 | 10,215,095 |
| | 11,532,491 | 10,321,518 | | | |
| DEUDORES DIVERSOS | | | | | |
| 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 | | | |
| | 834,333 | 814,282 | | | |
| TOTAL ACTIVO | 12,506,407 | 11,151,291 | TOTAL PASIVO MAS CAPITAL | 12,506,407 | 11,151,291 |

| 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 |
| Bancos divisas en moneda extranjera | 12,214 | 1,173 | | | |
| Dólares americanos | 6,249 | 329 | | | |
| Euros | 711 | 426 | | | |
| Yenes | 5,255 | 419 | | | |
| Divisas por entregar | 5,008 | - | | | |
| Dólares americanos | 5,008 | - | | | |
| Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga | 29,608,249 | 27,986,799 | | | |
| 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 | | | |
| Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta | 28,694,424 | 27,253,743 | | | |
| 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)

| | 2019 | 2018 |
|--|------------------|------------------|
| 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 |
| INGRESOS NETOS | 5,721,645 | 3,409,289 |
| 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 |
| EGRESOS NETOS | 4,999,593 | 2,920,448 |
| UTILIDAD DE OPERACIÓN | 722,051 | 488,841 |
| OTROS RESULTADOS INTEGRALES | | |
| PLUS (MINUS) VALÍAS | 460,426 | 866 |
| UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO | 1,182,477 | 489,707 |

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.