

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

**SIEFORE SURA BASICA 60-64 S.A. DE C.V. (ANTES: SIEFORE SURA BÁSICA 2, 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
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	10	10	Acreedores	80,225	44
Bancos monedas extranjeras	647,183	189,741	Provisiones para gastos	11,900	21,115
	647,193	189,751	Divisas por entregar	513,168	-
INVERSIONES			Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	6,201,514	6,265,512
Inversión en valores de renta variable	21,595,264	22,691,682			
Plus (Minus) valia en valores de renta variable	485,507	2,449,579	TOTAL PASIVO	6,806,806	6,286,671
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	71,592,609	75,841,108			
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	8,681,529	5,878,776			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	72,755,092	44,718,961			
Plus (Minus) valia en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	1,416,004	(2,282,205)			
Inversiones Tercerizadas	3,250,938	3,250,938	CAPITAL CONTABLE	2019	2018
Plus (Minus) valia en inversiones tercerizadas	863,652	524,512	CAPITAL		
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	6,141,808	10,664,800	CAPITAL CONTRIBUIDO	83,605,568	71,166,862
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	926,314	231,776	Capital social pagado	20,420,146	19,123,862
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	2,250,416	2,102,035	Prima en venta de acciones	63,185,422	52,043,000
Plus (Minus) valia instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	106,037	57,693			
Inversión en FIBRAS	6,658,833	5,971,474	CAPITAL GANADO	121,851,455	110,664,331
Plus (Minus) valia en Inversion en FIBRAS	(648,526)	(1,225,753)	Resultados de ejercicios anteriores	110,415,764	103,012,585
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	23,793	5,229	Resultados del ejercicio	11,435,691	7,651,746
Inversión en valores extranjeros de deuda	518,916	656,864			
Plus (Minus) valia en Inversión en valores extranjeros de deuda	17,532	34,227	OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
Inversión en títulos Fiduciarios	11,269,457	8,393,975	PLUS (MINUS) VALÍAS	13,984,396	7,737,249
Plus (minus) valia en Títulos Fiduciarios	1,819,233	1,992,747			
Inversión en instrumentos de deuda por reporto	3,660,547	2,369,592	TOTAL CAPITAL CONTABLE	219,441,419	189,568,442
Plus (Minus) valia de valores por reporto	11,320	5,753			
Valores Prestados	3,181,736	3,560,654			
Plus (Minus) valia de valores prestados	317,114	75,897			
	216,895,125	187,970,313			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	512,091	28,578			
Dividendos o derechos por cobrar	2,285	83,606			
Intereses devengados sobre valores	2,344,492	1,943,882			
Reportos	(11,181)	(5,752)			
Premios por cobrar por préstamo de valores	257	300			
Intereses devengados por instrumentos recibidos en reporto	15,635	12,901			
Intereses devengados sobre valores prestados	32,645	47,129			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	5,809,684	5,584,406			
	8,705,908	7,695,050			
TOTAL ACTIVO	226,248,225	195,855,113	TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	226,248,225	195,855,113

CUENTAS DE ORDEN	2019	2018	CUENTAS DE ORDEN	2019	2018
Valores entregados en custodia	209,557,814	181,605,387	Capital social autorizado	27,500,100	27,500,100
Valores entregados en custodia por reporto	3,676,321	2,382,493	Acciones emitidas	27,500,100,000	27,500,100,000
Valores prestados	3,498,850	3,636,551	Acciones en circulación, posición propia	152,794,444	141,144,726
Garantías recibidas por préstamo de valores	3,680,998	3,903,928	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	20,267,351,887	18,982,716,896
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	872,353	391,646			
Bancos divisas en moneda extranjera	49,142	49,560			
Dólares americanos	30,003	9,304			
Euros	2,418	413			
Yenes	16,721	39,843			
Divisas por entregar	26,004	-			
Dólares americanos	26,004	-			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	10,880,973	6,545,119			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	346,893,800	321,639,357			
Forwards sobre Renta Variable Extranjera	16,068,090	13,404,175			
Forwards sobre Dólar Americano	21,255,443	30,490,920			
Forwards sobre Euros	3,110,291	3,238,899			
Forwards sobre Otras Divisas	-	672,876			
Futuros sobre Renta Variable Extranjera	-	59,070			
Opciones sobre Renta Variable Nacional	3,101	3,511			
Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	99,849,225	94,525,769			
Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	43,085,904	29,839,902			
Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	3,250,080	3,508,537			
Swaps sobre Tasa Fija en Euros	3,454,436	2,247,090			
Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	117,360,713	104,640,043			
Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	36,138,196	35,690,244			
Swaps sobre Tasa Variable en Euros	3,318,322	3,318,322			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	332,531,845	307,292,689			
Forwards sobre Renta Variable Extranjera	5,969,474	2,706,570			
Forwards sobre Dólar Americano	18,177,545	25,373,832			
Forwards sobre Euros	523,780	1,538,427			
Forwards sobre Otras Divisas	-	675,758			
Futuros sobre Renta Variable Nacional	941,655	1,286,584			
Futuros sobre Dólar Americano	309,853	1,818,219			
Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	112,436,824	98,967,556			
Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	40,364,465	39,135,415			
Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	5,049,284	5,884,601			
Swaps sobre Tasa Fija en Euros	4,296,034	4,277,266			
Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	96,993,209	92,460,929			
Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	44,015,286	30,920,442			
Swaps sobre Tasa Variable en Euros	3,454,436	2,247,090			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$ 13,984,396	\$ 7,737,249
Un valor de los activos netos de:	\$ 219,441,419	\$ 189,568,442
El precio de la acción de:	\$ 10.746320	\$ 9.912665

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 60-64 S.A. DE C.V. (ANTES: SIEFORE SURA BÁSICA 2, 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	49,815,415	35,570,504
Intereses, dividendos, premios y derechos	8,984,060	7,682,978
Resultado cambiario / Otros productos	(17,722)	(244,351)
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	2,138,369	2,202,012
INGRESOS NETOS	60,920,123	45,211,143
Costo de ventas de valores	47,538,751	35,783,294
Gastos generales	155,244	102,995
Comisiones sobre saldos	1,530,896	1,405,739
Comisiones por servicios de tercerización	15,686	14,549
Intereses sobre inversiones en valores a entregar	243,856	252,819
EGRESOS NETOS	49,484,432	37,559,397
UTILIDAD DE OPERACIÓN	11,435,691	7,651,746
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	12,279,382	(862,523)
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	23,715,073	6,789,224

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.