

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 Siefiores, 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 serán aprobados en la sesión del Consejo de Administración con fecha 13 de Noviembre 2019.