

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

**SIEFORE SURA BASICA 60-64, 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 2020 Y 2019

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2020	2019	PASIVO	2020	2019
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	10	10	Acreedores	163,814	80,225
Bancos monedas extranjeras	77,227	647,183	Provisiones para gastos	3,717	11,900
Divisas por recibir	46,674	-	Divisas por entregar	40,792	513,168
	123,910	647,193	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	8,397,551	6,201,514
INVERSIONES			TOTAL PASIVO	8,605,873	6,806,806
Inversión en valores de renta variable	9,615,832	21,595,264			
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	351,641	485,507			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	18,908,824	71,592,609			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	4,064,893	8,681,529			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	23,163,380	72,755,092			
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	1,487,382	1,416,004			
Inversiones Tercerizadas	-	3,250,938			
Plus (Minus) valía en inversiones tercerizadas	-	863,652			
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	2,228,258	6,141,808			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	450,291	926,314			
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	3,011,922	2,250,416			
Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	404,854	106,037			
Inversión en FIBRAS	1,792,977	6,658,833			
Plus (Minus) valía en Inversion en FIBRAS	(487,948)	(648,526)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	-	23,793			
Inversión en valores extranjeros de deuda	145,426	518,916			
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	18,099	17,532			
Inversión en títulos Fiduciarios	2,780,393	11,269,457			
Plus (minus) valía en Títulos Fiduciarios	106,513	1,819,233			
Valores Prestados	636,032	3,181,736			
Plus (Minus) valía de valores prestados	113,719	317,114			
Inversión en Fondos Mutuos	1,636,736	-			
Plus (Minus) valía de Fondos Mutuos	202,634	-			
	70,631,860	213,223,258			
DEUDORES DIVERSOS			CAPITAL CONTABLE	2020	2019
Liquidadora	354,568	512,091	CAPITAL		
Dividendos o derechos por cobrar	6,434	2,285	CAPITAL CONTRIBUIDO	(61,952,652)	83,605,568
Intereses devengados sobre valores	720,413	2,344,492	Capital social pagado	6,291,708	20,420,146
Reportos	4,349,825	3,676,321	Prima en venta de acciones	(68,244,360)	63,185,422
Premios por cobrar por préstamo de valores	3	257	CAPITAL GANADO	130,088,809	121,851,455
Intereses devengados sobre valores prestados	8,151	32,645	Resultados de ejercicios anteriores	127,429,042	110,415,764
Reembolsos y otros intereses	246	-	Resultados del ejercicio	2,659,766	11,435,691
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	7,258,698	5,809,684	OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
	12,698,338	12,377,775	PLUS (MINUS) VALÍAS	6,712,079	13,984,396
TOTAL ACTIVO	83,454,109	226,248,225	TOTAL CAPITAL CONTABLE	74,848,236	219,441,419
			TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	83,454,109	226,248,225

CUENTAS DE ORDEN	2020	2019	CUENTAS DE ORDEN	2020	2019
Valores entregados en custodia	69,882,108	209,557,814	Capital social autorizado	27,500,100	27,500,100
Valores prestados	749,752	3,498,850	Acciones emitidas	27,500,100,000	27,500,100,000
Garantías recibidas por valores prestados	796,392	3,680,998	Acciones en circulación, posición propia	41,879,649	152,794,444
Colaterales recibidos por reportos	4,349,265	-	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	6,249,828,774	20,267,351,887
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	902,768	872,353			
Bancos divisas en moneda extranjera	59,050	49,142			
Dólares americanos	2,956	30,003			
Euros	-	2,418			
Yenes	56,095	16,721			
Divisas por recibir	2,108	-			
Dólares americanos	2,108	-			
Divisas por entregar	1,842	26,004			
Dólares americanos	1,842	26,004			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	3,043,502	10,880,973			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	315,181,041	346,893,800			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	5,663,495	16,068,090			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	11,512,945	21,255,443			
Contratos Adelantados sobre Euros	2,332,342	3,110,291			
Contratos de Opciones sobre Renta Variable Nacional	-	3,101			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	90,650,992	99,849,225			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	49,891,205	43,085,904			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	4,124,535	3,250,080			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	337,691	3,454,436			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	105,746,591	117,360,713			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	44,860,763	36,138,196			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	-	3,318,322			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	60,483	-			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	307,598,018	332,531,845			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	421,511	5,969,474			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	9,662,665	18,177,545			
Contratos Adelantados sobre Euros	366,517	523,780			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	1,148,002	-			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	-	941,655			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	320,253	309,853			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	101,593,034	112,436,824			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	46,397,456	40,364,465			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	3,212,648	5,049,284			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	518,978	4,296,034			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	92,430,383	96,993,209			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	51,188,880	44,015,286			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	337,691	3,454,436			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$	6,712,079	\$	13,984,396
Un valor de los activos netos de:	\$	74,848,236	\$	219,441,419
El precio de la acción de:	\$	11.896329	\$	10.746320

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 60-64, S.A. DE C.V., SOCIEDAD DE INVERSIÓN ESPECIALIZADA DE FONDOS PARA EL RETIRO
SOCIEDAD DE INVERSIÓN BÁSICA**

ESTADO DE RESULTADOS INTEGRAL POR LOS PERIODOS DEL 1 DE ENERO AL 30 DE SEPTIEMBRE DE 2020 Y 2019

(Cifras en miles de pesos)

	2020	2019
Ingresos por la venta de Valores	20,223,388	49,815,415
Intereses, dividendos, premios y derechos	2,751,772	8,740,204
Resultado cambiario / Otros productos	74,551	(17,722)
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	(920,907)	2,138,369
INGRESOS NETOS	22,128,803	60,676,267
Costo de ventas de valores	18,952,624	47,538,751
Gastos generales	23,574	155,244
Comisiones sobre saldos	489,050	1,530,896
Comisiones por servicios de tercerización	-	15,686
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	3,788	-
EGRESOS NETOS	19,469,037	49,240,576
UTILIDAD DE OPERACIÓN	2,659,766	11,435,691
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	2,997,618	12,279,382
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	5,657,385	23,715,073

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.