

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

**SIEFORE SURA BASBICA 85-89 S.A. DE C.V. (ANTES: SIEFORE SURA BÁSICA 4, 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	772,946	2,354
Bancos monedas extranjeras	347,051	85,157	Provisiones para gastos	9,368	15,598
	347,061	85,167	Divisas por entregar	236,814	-
INVERSIONES			Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	5,513,844	6,670,723
Inversión en valores de renta variable	17,388,634	20,136,590			
Plus (Minus) valia en valores de renta variable	54,051	1,346,085	TOTAL PASIVO	6,532,972	6,688,676
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	38,505,536	46,150,746			
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	3,761,149	2,516,787			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	50,509,367	28,262,260			
Plus (Minus) valia en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	1,124,625	(1,302,076)			
Inversiones Tercerizadas	3,064,120	3,064,120	CAPITAL CONTABLE	2019	2018
Plus (Minus) valia en inversiones tercerizadas	820,495	504,615	CAPITAL		
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	3,491,738	6,768,781	CAPITAL CONTRIBUIDO	78,482,968	74,015,285
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	418,476	30,903	Capital social pagado	59,297,208	57,560,137
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	1,475,415	2,226,194	Prima en venta de acciones	19,185,759	16,455,148
Plus (Minus) valia instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	55,454	79,410	CAPITAL GANADO	55,773,763	49,813,467
Inversión en FIBRAS	4,079,732	3,922,081	Resultados de ejercicios anteriores	48,079,485	44,080,471
Plus (Minus) valia en Inversion en FIBRAS	(326,122)	(767,272)	Resultados del ejercicio	7,694,278	5,732,995
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	20,123	9,373	OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
Inversión en valores extranjeros de deuda	170,717	245,073	PLUS (MINUS) VALÍAS	7,224,659	3,714,556
Plus (Minus) valia en Inversión en valores extranjeros de deuda	6,730	13,276			
Inversión en títulos Fiduciarios	8,135,188	6,159,139	TOTAL CAPITAL CONTABLE	141,481,390	127,543,308
Plus (minus) valia en Títulos Fiducarios	1,116,178	1,268,071			
Inversión en instrumentos de deuda por reporto	4,694,645	3,170,743			
Plus (Minus) valia de valores por reporto	10,338	7,630			
Valores Prestados	1,764,532	2,656,671			
Plus (Minus) valia de valores prestados	193,624	24,758			
	140,534,745	126,493,956			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	236,933	589,460			
Dividendos o derechos por cobrar	2,118	50,205			
Intereses devengados sobre valores	1,367,525	1,179,010			
Reportos	(10,180)	(7,638)			
Premios por cobrar por préstamo de valores	170	147			
Intereses devengados por instrumentos recibidos en reporto	7,515	12,877			
Intereses devengados sobre valores prestados	23,505	46,291			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	5,504,970	5,782,509			
	7,132,555	7,652,862			
TOTAL ACTIVO	148,014,362	134,231,984	TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	148,014,362	134,231,984

CUENTAS DE ORDEN	2019	2018	CUENTAS DE ORDEN	2019	2018
Valores entregados en custodia	133,712,083	120,410,982	Capital social autorizado	126,259,200	126,259,200
Valores entregados en custodia por reporto	4,702,318	3,183,611	Acciones emitidas	25,000,019,801	25,000,019,801
Valores prestados	1,958,155	2,681,428	Acciones en circulación, posición propia	88,003,298	85,716,879
Garantías recibidas por préstamo de valores	2,066,477	2,872,822	Acciones de Siefores, posición de terceros	2	2
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	1,063,423	790,881	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	11,653,171,839	11,311,508,583
Bancos divisas en moneda extranjera	29,898	102,703			
Dólares americanos	15,599	2,998			
Euros	1,715	583			
Yenes	12,584	99,121			
Divisas por entregar	12,000	-			
Dólares americanos	12,000	-			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	9,444,858	5,877,930			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	266,692,610	270,399,494			
Forwards sobre Renta Variable Extranjera	15,354,460	14,172,432			
Forwards sobre Dólar Americano	12,319,893	20,801,663			
Forwards sobre Euros	2,712,266	2,200,017			
Forwards sobre Otras Divisas	-	610,410			
Futuros sobre Renta Variable Nacional	1,424,555	1,404,005			
Futuros sobre Renta Variable Extranjera	-	174,397			
Opciones sobre Renta Variable Nacional	1,990	2,894			
Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	83,594,495	86,982,143			
Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	32,447,369	22,757,859			
Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	4,193,871	6,044,711			
Swaps sobre Tasa Fija en Euros	1,957,562	1,282,303			
Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	86,440,967	89,954,736			
Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	24,393,417	22,160,159			
Swaps sobre Tasa Variable en Euros	1,851,766	1,851,766			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	254,818,586	254,999,379			
Forwards sobre Renta Variable Extranjera	5,269,733	3,019,227			
Forwards sobre Dólar Americano	13,683,765	18,849,037			
Forwards sobre Euros	549,990	934,863			
Forwards sobre Otras Divisas	-	614,212			
Futuros sobre Dólar Americano	391,108	475,941			
Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	83,483,248	84,510,285			
Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	27,305,869	24,731,452			
Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	4,493,553	7,308,600			
Swaps sobre Tasa Fija en Euros	2,509,034	2,537,132			
Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	81,903,024	85,896,455			
Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	33,271,700	24,839,873			
Swaps sobre Tasa Variable en Euros	1,957,562	1,282,303			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$	7,224,659	\$	3,714,556
Un valor de los activos netos de:	\$	141,481,390	\$	127,543,308
El precio de la acción de:	\$	12.050020	\$	11.190733

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 BASBICA 85-89 S.A. DE C.V. (ANTES: SIEFORE SURA BÁSICA 4, 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	31,923,839	23,598,073
Intereses, dividendos, premios y derechos	5,663,284	4,967,524
Resultado cambiario / Otros productos	28,759	(129,217)
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	2,681,485	2,221,875
INGRESOS NETOS	40,297,367	30,658,256
Costo de ventas de valores	31,160,081	23,625,254
Gastos generales	122,594	75,935
Comisiones sobre saldos	930,372	890,464
Comisiones por servicios de tercerización	14,783	13,728
Intereses sobre inversiones en valores a entregar	375,260	319,880
EGRESOS NETOS	32,603,089	24,925,260
UTILIDAD DE OPERACIÓN	7,694,278	5,732,995
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	7,865,145	(834,165)
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	15,559,424	4,898,830

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.