

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

**SIEFORE SURA BASICA 85-89, 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	163,915	772,946
Bancos monedas extranjeras	88,445	347,051	Provisiones para gastos	4,460	9,368
Divisas por recibir	69,710	-	Divisas por entregar	64,484	236,814
	158,166	347,061	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	6,874,141	5,513,844
INVERSIONES			TOTAL PASIVO	7,107,000	6,532,972
Inversión en valores de renta variable	12,159,879	17,388,634			
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	289,371	54,051			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	13,930,408	38,505,536			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	2,461,247	3,761,149			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	18,514,608	50,509,367			
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	1,285,509	1,124,625			
Inversiones Tercerizadas	-	3,064,120			
Plus (Minus) valía en inversiones tercerizadas	-	820,495			
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	1,766,000	3,491,738			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	216,013	418,476			
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	1,605,136	1,475,415			
Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	185,862	55,454			
Inversión en FIBRAS	1,761,057	4,079,732			
Plus (Minus) valía en Inversión en FIBRAS	(422,515)	(326,122)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	8,225	20,123			
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	1	-			
Inversión en valores extranjeros de deuda	64,945	170,717			
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	6,915	6,730			
Inversión en títulos Fiduciarios	4,171,167	8,135,188			
Plus (minus) valía en Títulos Fiduciarios	306,955	1,116,178			
Valores Prestados	375,255	1,764,532			
Plus (Minus) valía de valores prestados	34,190	193,624			
Inversión en Fondos Mutuos	2,598,248	-			
Plus (Minus) valía de Fondos Mutuos	269,511	-			
	61,587,985	135,829,761			
DEUDORES DIVERSOS			CAPITAL CONTABLE	2020	2019
Liquidadora	299,677	236,933	CAPITAL		
Dividendos o derechos por cobrar	7,918	2,118	CAPITAL CONTRIBUIDO	3,147	78,482,968
Intereses devengados sobre valores	518,849	1,367,525	Capital social pagado	25,391,706	59,297,208
Reportos	4,097,296	4,702,318	Prima en venta de acciones	(25,388,559)	19,185,759
Premios por cobrar por préstamo de valores	2	170	CAPITAL GANADO	62,314,288	55,773,763
Intereses devengados sobre valores prestados	1,342	23,505	Resultados de ejercicios anteriores	59,885,630	48,079,485
Reembolsos y otros intereses	331	-	Resultados del ejercicio	2,428,658	7,694,278
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	7,385,925	5,504,970	OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
	12,311,339	11,837,539	PLUS (MINUS) VALÍAS	4,633,056	7,224,659
TOTAL ACTIVO	74,057,490	148,014,362	TOTAL CAPITAL CONTABLE	66,950,490	141,481,390
			TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	74,057,490	148,014,362

CUENTAS DE ORDEN	2020	2019	CUENTAS DE ORDEN	2020	2019
Valores entregados en custodia	61,170,315	133,712,083	Capital social autorizado	126,259,200	126,259,200
Valores prestados	409,445	1,958,155	Acciones emitidas	25,000,019,801	25,000,019,801
Garantías recibidas por valores prestados	429,443	2,066,477	Acciones en circulación, posición propia	32,158,566	88,003,298
Colaterales recibidos por reportos	4,097,544	-	Acciones de Siefores, posición de terceros	2	2
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	1,523,419	1,063,423	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	4,995,539,627	11,653,171,839
Bancos divisas en moneda extranjera	62,663	29,898			
Dólares americanos	3,433	15,599			
Euros	-	1,715			
Yenes	59,230	12,584			
Divisas por recibir	3,148	-			
Dólares americanos	3,148	-			
Divisas por entregar	2,912	12,000			
Dólares americanos	2,912	12,000			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	5,809,348	9,444,858			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	245,937,045	266,692,610			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	11,220,181	15,354,460			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	11,094,681	12,319,893			
Contratos Adelantados sobre Euros	2,996,961	2,712,266			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	270,452	1,424,555			
Contratos de Opciones sobre Renta Variable Nacional	-	1,990			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	75,329,823	83,594,495			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	32,674,923	32,447,369			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	3,579,989	4,193,871			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	119,905	1,957,562			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	81,810,762	86,440,967			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	26,751,672	24,393,417			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	-	1,851,766			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	87,696	-			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	236,953,529	254,818,586			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	595,149	5,269,733			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	13,459,326	13,683,765			
Contratos Adelantados sobre Euros	565,244	549,990			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	1,731,713	-			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	442,719	391,108			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	80,059,603	83,483,248			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	27,364,632	27,305,869			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	3,061,883	4,493,553			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	266,202	2,509,034			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	75,540,216	81,903,024			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	33,746,937	33,271,700			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	119,905	1,957,562			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$	4,633,056	\$	7,224,659
Un valor de los activos netos de:	\$	66,950,490	\$	141,481,390
El precio de la acción de:	\$	13.316330	\$	12.050020

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 85-89, 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	20,659,704	31,923,839
Intereses, dividendos, premios y derechos	2,143,892	5,288,025
Resultado cambiario / Otros productos	77,930	28,759
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	(408,435)	2,681,485
INGRESOS NETOS	22,473,091	39,922,108
Costo de ventas de valores	19,606,483	31,160,081
Gastos generales	22,381	122,594
Comisiones sobre saldos	410,151	930,372
Comisiones por servicios de tercerización	-	14,783
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	5,419	-
EGRESOS NETOS	20,044,433	32,227,830
UTILIDAD DE OPERACIÓN	2,428,658	7,694,278
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	2,307,007	7,865,145
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	4,735,664	15,559,424

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.