

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

**SIEFORE SURA BASICA 75-79, 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 JUNIO DE 2020 Y 2019

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2020	2019	PASIVO	2020	2019
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	10	1,159	Acreedores	974,119	1,154,307
Bancos monedas extranjeras	44,792	40,010	Provisiones para gastos	5,663	20,514
Divisas por recibir	891,678	405,118	Divisas por entregar	877,731	398,124
	936,481	446,287	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	10,383,801	6,043,124
RESERVADOS			TOTAL PASIVO	12,241,314	7,616,069
Bancos Moneda Nal., Depósitos reserv. al pago compromisos futuros en pesos	-	13,604			
	-	13,604			
INVERSIONES			CAPITAL CONTABLE	2020	2019
Inversión en valores de renta variable	16,309,115	20,270,706	CAPITAL		
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	490,114	602,610	CAPITAL CONTRIBUIDO		
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	29,358,803	59,522,548	Capital social pagado	47,098,450	81,343,529
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	5,686,788	6,608,431	Prima en venta de acciones	(20,662,377)	18,470,201
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	31,333,018	43,474,074	CAPITAL GANADO	75,964,425	66,735,873
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	2,381,778	(339,212)	Resultados de ejercicios anteriores	75,690,810	59,908,016
Inversiones Tercerizadas	-	3,488,726	Resultados del ejercicio	273,615	6,827,856
Plus (Minus) valía en inversiones tercerizadas	-	794,301	OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	3,055,749	6,166,902	PLUS (MINUS) VALÍAS	9,879,929	10,153,416
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	693,048	621,156	TOTAL CAPITAL CONTABLE	112,280,427	176,703,019
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	3,575,982	2,742,728			
Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	416,829	17,527			
Inversión en FIBRAS	3,563,492	6,465,975			
Plus (Minus) valía en Inversión en FIBRAS	(1,037,500)	(1,306,408)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	-	2,755			
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	45	-			
Inversión en valores extranjeros de deuda	231,512	411,028			
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	23,812	(3,026)			
Inversión en títulos Fiduciarios	8,118,028	11,442,631			
Plus (minus) valía en Títulos Fiduciarios	674,996	2,549,461			
Valores Prestados	1,095,795	7,893,115			
Plus (Minus) valía de valores prestados	180,168	608,577			
Inversión en Fondos Mutuos	2,258,361	-			
Plus (Minus) valía de Fondos Mutuos	369,896	-			
	108,779,828	172,034,603			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	13,850	20,436			
Dividendos o derechos por cobrar	132	-			
Intereses devengados sobre valores	668,282	893,121			
Reportos	6,115,051	6,045,364			
Premios por cobrar por préstamo de valores	19	636			
Intereses devengados sobre valores prestados	2,463	121,813			
Reembolsos y otros intereses	342	-			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	8,005,292	4,743,223			
	14,805,432	11,824,594			
TOTAL ACTIVO	124,521,740	184,319,088	TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	124,521,740	184,319,088

CUENTAS DE ORDEN	2020	2019	CUENTAS DE ORDEN	2020	2019
Valores entregados en custodia	107,503,821	162,873,556	Capital social autorizado	126,259,200	126,259,200
Valores prestados	1,275,962	8,501,692	Acciones emitidas	25,000,019,801	25,000,019,801
Garantías recibidas por valores prestados	1,342,483	9,034,565	Acciones en circulación, posición propia	62,229,418	119,636,889
Colaterales recibidos por reportos	6,105,209	-	Acciones de Siefores, posición de terceros	2	2
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	222,069	559,407	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	9,263,524,081	15,986,831,586
Bancos divisas en moneda extranjera	54,687	24,751			
Dólares americanos	1,447	1,461			
Euros	-	360			
Yenes	53,241	22,930			
Divisas por recibir	38,619	21,079			
Dólares americanos	38,619	21,000			
Euros	-	79			
Divisas por entregar	38,015	20,726			
Dólares americanos	38,015	20,726			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	9,916,620	11,641,187			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	290,323,669	318,451,195			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	13,371,474	14,933,986			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	16,502,521	21,884,442			
Contratos Adelantados sobre Euros	3,953,845	3,034,159			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Extranjera	-	49,349			
Contratos de Opciones sobre Renta Variable Nacional	2,803	2,803			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	85,525,061	93,911,380			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	35,493,858	38,958,176			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	5,356,623	3,283,547			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	249,598	3,023,005			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	99,287,104	102,700,868			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	30,440,109	33,717,694			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	-	2,951,785			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	140,672	-			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	275,253,907	302,020,424			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	320,615	3,637,561			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	15,272,379	18,535,963			
Contratos Adelantados sobre Euros	1,472,442	434,752			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	1,203,557	-			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	-	305,882			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	335,543	369,824			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	94,695,109	97,933,873			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	32,477,862	37,536,773			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	4,030,361	5,142,344			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	458,911	3,694,375			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	88,305,408	91,509,631			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	36,432,124	39,896,442			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	249,598	3,023,005			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$	9,879,929	\$	10,153,416
Un valor de los activos netos de:	\$	112,280,427	\$	176,703,019
El precio de la acción de:	\$	12.039824	\$	10.970935

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 75-79, 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 31 DE JUNIO DE 2020 Y 2019

(Cifras en miles de pesos)

	2020	2019
Ingresos por la venta de Valores	22,241,310	14,756,210
Intereses, dividendos, premios y derechos	2,666,733	4,758,828
Resultado cambiario / Otros productos	63,195	(47,626)
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	(2,340,946)	2,787,683
INGRESOS NETOS	22,630,292	22,255,096
Costo de ventas de valores	21,846,899	14,511,477
Gastos generales	24,643	88,795
Comisiones sobre saldos	480,990	816,106
Comisiones por servicios de tercerización	-	10,861
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	4,145	-
EGRESOS NETOS	22,356,677	15,427,239
UTILIDAD DE OPERACIÓN	273,615	6,827,856
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	4,038,415	8,126,958
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	4,312,030	14,954,815

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.
En la Sesión del Consejo de Administración con fecha 6 de Mayo de 2020 fueron aprobados los Estados Financieros al 31 de Marzo de 2020, Así mismo los presentes Estados Financieros al 30 de Junio del 2020 serán aprobados en la sesión del Consejo de Administración con fecha 24 de Julio 2020