

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

**SIEFORE SURA BASBICA 75-79 S.A. DE C.V. (ANTES: SIEFORE SURA BÁSICA 3, 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	569,152	159
Bancos monedas extranjeras	584,395	183,156	Provisiones para gastos	11,315	19,835
	584,405	183,166	Divisas por entregar	453,894	-
INVERSIONES			Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	6,237,942	7,624,989
Inversión en valores de renta variable	18,011,023	20,944,608			
Plus (Minus) valia en valores de renta variable	183,433	1,994,038	TOTAL PASIVO	7,272,302	7,644,983
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	60,271,552	65,004,133			
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	7,239,247	4,995,970			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	58,771,323	37,178,643			
Plus (Minus) valia en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	1,235,773	(1,740,638)	CAPITAL CONTABLE	2019	2018
Inversiones Tercerizadas	3,488,726	3,488,726	CAPITAL		
Plus (Minus) valia en inversiones tercerizadas	933,827	573,734	CAPITAL CONTRIBUIDO	102,750,549	101,034,813
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	4,653,166	9,217,284	Capital social pagado	82,676,705	82,044,550
Plus(Minus)valia instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	738,125	233,539	Prima en venta de acciones	20,073,844	18,990,263
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	2,004,379	2,740,334			
Plus (Minus) valia instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	77,475	83,057	CAPITAL GANADO	70,259,825	61,010,406
Inversión en FIBRAS	6,630,579	6,133,113	Resultados de ejercicios anteriores	59,908,016	54,134,985
Plus (Minus) valia en Inversion en FIBRAS	(678,718)	(1,263,196)	Resultados del ejercicio	10,351,809	6,875,422
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	14,805	24,043			
Inversión en valores extranjeros de deuda	411,028	572,141	OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
Plus (Minus) valia en Inversión en valores extranjeros de deuda	10,952	27,999	PLUS (MINUS) VALÍAS	11,975,258	7,485,436
Inversión en títulos Fiduciarios	12,353,381	9,719,402			
Plus (minus) valia en Títulos Fiducarios	2,150,508	2,479,450	TOTAL CAPITAL CONTABLE	184,985,632	169,530,655
Inversión en instrumentos de deuda por reporto	3,405,477	2,272,205			
Plus (Minus) valia de valores por reporto	8,499	5,923			
Valores Prestados	1,728,607	4,304,730			
Plus (Minus) valia de valores prestados	84,636	101,484			
	183,727,803	169,090,719			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	454,247	27,666			
Dividendos o derechos por cobrar	2,154	95,216			
Intereses devengados sobre valores	1,862,985	1,645,462			
Reportos	(8,377)	(5,922)			
Premios por cobrar por préstamo de valores	34	213			
Intereses devengados por instrumentos recibidos en reporto	11,515	12,372			
Intereses devengados sobre valores prestados	8,675	61,527			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	5,614,493	6,065,219			
	7,945,726	7,901,753			
TOTAL ACTIVO	192,257,934	177,175,638	TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	192,257,934	177,175,638

CUENTAS DE ORDEN	2019	2018	CUENTAS DE ORDEN	2019	2018
Valores entregados en custodia	178,180,579	161,746,735	Capital social autorizado	126,259,200	126,259,200
Valores entregados en custodia por reporto	3,417,113	2,284,577	Acciones emitidas	25,000,019,801	25,000,019,801
Valores prestados	1,813,243	4,406,213	Acciones en circulación, posición propia	121,523,740	120,461,375
Garantías recibidas por préstamo de valores	1,908,619	4,742,278	Acciones de Siefores, posición de terceros	2	2
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	819,429	453,148	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	16,248,921,091	16,124,813,211
Bancos divisas en moneda extranjera	52,119	76,472			
Dólares americanos	26,840	8,560			
Euros	2,349	542			
Yenes	22,930	67,370			
Divisas por entregar	23,000	-			
Dólares americanos	23,000	-			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	11,619,020	7,290,313			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	325,182,199	329,258,521			
Forwards sobre Renta Variable Extranjera	17,242,851	15,811,407			
Forwards sobre Dólar Americano	18,916,037	29,597,970			
Forwards sobre Euros	3,711,916	3,003,623			
Forwards sobre Otras Divisas	-	771,849			
Futuros sobre Renta Variable Extranjera	-	407,864			
Opciones sobre Renta Variable Nacional	2,803	3,526			
Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	97,269,380	100,765,762			
Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	40,739,454	31,950,144			
Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	3,283,547	4,299,396			
Swaps sobre Tasa Fija en Euros	3,023,005	1,941,736			
Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	107,398,810	107,450,390			
Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	30,642,609	30,303,069			
Swaps sobre Tasa Variable en Euros	2,951,785	2,951,785			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	309,214,455	310,211,914			
Forwards sobre Renta Variable Extranjera	5,854,305	3,197,565			
Forwards sobre Dólar Americano	16,538,632	23,309,559			
Forwards sobre Euros	625,183	1,042,215			
Forwards sobre Otras Divisas	-	774,940			
Futuros sobre Renta Variable Nacional	327,933	436,421			
Futuros sobre Dólar Americano	369,824	1,611,611			
Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	102,631,815	100,955,779			
Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	34,461,688	33,553,699			
Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	5,142,344	7,082,942			
Swaps sobre Tasa Fija en Euros	3,694,375	3,717,620			
Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	94,867,631	98,908,316			
Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	41,677,720	33,679,511			
Swaps sobre Tasa Variable en Euros	3,023,005	1,941,736			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$ 11,975,258	\$ 7,485,436
Un valor de los activos netos de:	\$ 184,985,632	\$ 169,530,655
El precio de la acción de:	\$ 11.299976	\$ 10.435690

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 75-79 S.A. DE C.V. (ANTES: SIEFORE SURA BÁSICA 3, 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	39,545,713	31,980,983
Intereses, dividendos, premios y derechos	7,664,457	6,878,111
Resultado cambiario / Otros productos	708	(266,651)
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	2,941,069	2,258,073
INGRESOS NETOS	50,151,947	40,850,516
Costo de ventas de valores	38,091,779	32,421,735
Gastos generales	154,830	95,875
Comisiones sobre saldos	1,261,981	1,238,837
Comisiones por servicios de tercerización	16,833	15,630
Intereses sobre inversiones en valores a entregar	274,714	203,018
EGRESOS NETOS	39,800,138	33,975,095
UTILIDAD DE OPERACIÓN	10,351,809	6,875,422
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	9,948,800	(580,338)
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	20,300,608	6,295,083

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 30 de Septiembre del 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.