

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 31 DE MARZO DE 2020 Y 2019

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2020	2019	PASIVO	2020	2019
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	10	10	Acreedores	465,838	1,060,210
Bancos monedas extranjeras	84,880	1,016,129	Provisiones para gastos	4,909	19,397
Divisas por recibir	790,713	32,463	Divisas por entregar	808,388	988,273
	875,603	1,048,601	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	11,674,885	5,659,306
INVERSIONES			TOTAL PASIVO	12,954,020	7,727,186
Inversión en valores de renta variable	15,146,428	19,183,406			
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	(1,127,601)	881,592			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	30,271,032	58,943,351			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	3,085,207	5,122,796			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	30,553,704	40,381,554			
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	519,440	(1,419,559)			
Inversiones Tercerizadas	-	3,488,726			
Plus (Minus) valía en inversiones tercerizadas	-	686,218			
Depósito Traspaso Banxico	2,689	6,817			
Plus (Minus) valía en inversión en el Depósito Traspaso Banxico	42	36			
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	2,791,280	6,454,146			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	262,813	564,579			
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	5,022,292	2,930,699			
Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	175,957	(23,106)			
Inversión en FIBRAS	3,562,524	6,466,068			
Plus (Minus) valía en Inversion en FIBRAS	(1,137,845)	(1,178,764)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	-	26,254			
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	738	-			
Inversión en valores extranjeros de deuda	231,512	411,028			
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	5,290	(15,386)			
Inversión en títulos Fiduciarios	7,140,995	10,533,931			
Plus (minus) valía en Títulos Fiduciarios	826,907	2,757,955			
Valores Prestados	441,690	6,854,909			
Plus (Minus) valía de valores prestados	16,791	236,023			
Inversión en Fondos Mutuos	1,672,084	-			
Plus (Minus) valía de Fondos Mutuos	124,204	-			
	99,588,172	163,293,271			
DEUDORES DIVERSOS			CAPITAL CONTABLE	2020	2019
Liquidadora	26,118	1,151,797	CAPITAL		
Dividendos o derechos por cobrar	66	9,963	CAPITAL CONTRIBUIDO	25,466,479	98,232,608
Intereses devengados sobre valores	1,025,626	1,591,940	Capital social pagado	46,666,803	80,597,194
Reportos	2,530,476	6,338,038	Prima en venta de acciones	(21,200,324)	17,635,414
Premios por cobrar por préstamo de valores	44	334	CAPITAL GANADO	71,881,078	63,560,655
Intereses devengados sobre valores prestados	2,122	90,161	Resultados de ejercicios anteriores	75,690,810	59,908,016
Reembolsos y otros intereses	530	-	Resultados del ejercicio	(3,809,733)	3,652,638
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	9,004,023	3,608,728	OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
	12,589,005	12,790,960	PLUS (MINUS) VALÍAS	2,751,203	7,612,384
	113,052,780	177,132,833	TOTAL CAPITAL CONTABLE	100,098,760	169,405,647
TOTAL ACTIVO			TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	113,052,780	177,132,833

CUENTAS DE ORDEN	2020	2019	CUENTAS DE ORDEN	2020	2019
Valores entregados en custodia	98,932,754	155,437,485	Capital social autorizado	126,259,200	126,259,200
Valores prestados	458,481	7,090,932	Acciones emitidas	25,000,019,801	25,000,019,801
Garantías recibidas por valores prestados	472,303	7,616,403	Acciones en circulación, posición propia	67,166,855	118,607,423
Colaterales recibidos por reportos	2,535,503	-	Acciones de Siefores, posición de terceros	2	2
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	981,751	394,680	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	9,173,118,218	15,840,082,586
Bancos divisas en moneda extranjera	56,280	75,096			
Dólares americanos	2,237	51,633			
Euros	802	533			
Yenes	53,241	22,930			
Divisas por recibir	33,669	1,675			
Dólares americanos	33,669	1,675			
Divisas por entregar	34,422	51,000			
Dólares americanos	34,422	51,000			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	6,384,438	9,020,318			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	298,065,700	301,881,096			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	13,881,752	14,413,890			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	13,544,421	19,875,437			
Contratos Adelantados sobre Euros	1,943,340	3,034,159			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	90,274	-			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	560,728	-			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Extranjera	-	405,143			
Contratos de Opciones sobre Renta Variable Nacional	2,803	2,803			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	90,558,161	93,837,789			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	37,159,513	35,063,329			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	2,923,686	3,283,547			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	3,023,005	1,941,736			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	98,326,410	96,987,368			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	32,871,295	30,084,110			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	3,039,640	2,951,785			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	140,672	-			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	288,230,819	283,218,887			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	707,328	3,123,522			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	17,303,133	14,657,108			
Contratos Adelantados sobre Euros	1,472,442	434,752			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	167,036	-			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	-	295,223			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	382,238	369,824			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	93,734,415	92,220,373			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	34,909,048	33,582,205			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	4,030,361	5,142,344			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	3,498,551	3,694,375			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	90,905,484	91,755,831			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	38,097,779	36,001,595			
Contratos de 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:	\$	2,751,203	\$	7,612,384
Un valor de los activos netos de:	\$	100,098,760	\$	169,405,647
El precio de la acción de:	\$	10.832865	\$	10.615260

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 BASICA 75-79, 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 31 DE MARZO DE 2020 Y 2019

(Cifras en miles de pesos)

	2020	2019
Ingresos por la venta de Valores	13,413,743	10,345,694
Intereses, dividendos, premios y derechos	1,309,003	1,981,609
Resultado cambiario / Otros productos	(75,532)	(35,541)
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	(5,128,225)	1,853,441
INGRESOS NETOS	9,518,989	14,145,203
Costo de ventas de valores	13,075,672	10,044,345
Gastos generales	14,446	49,807
Comisiones sobre saldos	237,074	393,201
Comisiones por servicios de tercerización	-	5,212
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	1,531	-
EGRESOS NETOS	13,328,722	10,492,565
UTILIDAD DE OPERACIÓN	(3,809,733)	3,652,638
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(3,090,311)	5,585,926
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	(6,900,043)	9,238,565

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 11 de Febrero de 2020 fueron aprobados los Estados Financieros al 31 de Diciembre de 2019, Así mismo los presentes Estados Financieros al 31 de Marzo 2020 serán aprobados en la sesión del Consejo de Administración con fecha 6 de Mayo 2020