

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

**SIEFORE SURA BASICA 55-59, 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	32,563	20,278
Bancos monedas extranjeras	12,580	41,581	Provisiones para gastos	713	1,036
Divisas por recibir	39,659	-	Divisas por entregar	40,175	19,378
	52,249	41,591	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	1,510,260	778,815
INVERSIONES			TOTAL PASIVO	1,583,711	819,506
Inversión en valores de renta variable	1,125,591	675,089			
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	(56,505)	40,404			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	9,324,466	5,405,124			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	1,206,251	810,541			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	7,788,830	3,153,289			
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	205,389	(92,576)			
Depósito Traspaso Banxico	4,936	2,904			
Plus (Minus) valía en inversión en el Depósito Traspaso Banxico	76	15			
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	494,808	569,149			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	49,981	92,592			
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	745,900	359,427			
Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	22,277	699			
Inversión en FIBRAS	577,003	2,759			
Plus (Minus) valía en Inversión en FIBRAS	(197,717)	(165)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	-	5,996			
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	25	-			
Inversión en valores extranjeros de deuda	141,591	139,537			
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	20,751	13,015			
Valores Prestados	-	934,330			
Plus (Minus) valía de valores prestados	-	36,259			
Inversión en Fondos Mutuos	96,368	-			
Plus (Minus) valía de Fondos Mutuos	6,729	-			
	21,556,748	12,148,389			
DEUDORES DIVERSOS			CAPITAL CONTABLE	2020	2019
Liquidadora	3,208	31,991	CAPITAL		
Dividendos o derechos por cobrar	2	-	CAPITAL CONTRIBUIDO	8,983,010	541,925
Intereses devengados sobre valores	254,359	142,496	Capital social pagado	7,751,511	4,610,684
Reportos	401,325	138,881	Prima en venta de acciones	1,231,499	(4,068,759)
Premios por cobrar por préstamo de valores	-	48	CAPITAL GANADO	11,706,965	10,814,544
Intereses devengados sobre valores prestados	-	10,872	Resultados de ejercicios anteriores	11,560,947	10,569,101
Reembolsos y otros intereses	30	-	Resultados del ejercicio	146,018	245,444
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	1,262,996	562,492	OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
	1,921,921	886,780	PLUS (MINUS) VALÍAS	1,257,232	900,784
			TOTAL CAPITAL CONTABLE	21,947,207	12,257,254
TOTAL ACTIVO	23,530,919	13,076,760	TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	23,530,919	13,076,760

CUENTAS DE ORDEN	2020	2019	CUENTAS DE ORDEN	2020	2019
Valores entregados en custodia	21,235,124	11,020,203	Capital social autorizado	11,354,689	11,354,689
Valores prestados	-	970,589	Acciones emitidas	3,200,028,183	3,200,028,183
Garantías recibidas por valores prestados	-	1,033,651	Acciones en circulación, posición propia	19,735,566	9,699,112
Colaterales recibidos por reportos	401,913	-	Acciones de Siefores, posición de terceros	1,127	1,127
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	246,228	66,933	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	2,164,828,188	1,289,703,048
Bancos divisas en moneda extranjera	5,592	7,327			
Dólares americanos	280	1,852			
Euros	189	219			
Yenes	5,123	5,255			
Divisas por recibir	1,689	-			
Dólares americanos	1,689	-			
Divisas por entregar	1,711	1,000			
Dólares americanos	1,711	1,000			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	34,567,296	27,267,347			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	503,580	127,395			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	1,802,567	1,449,038			
Contratos Adelantados sobre Euros	227,143	92,739			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	11,600	-			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	20,658	-			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	206,615	-			
Contratos de Opciones sobre Renta Variable Nacional	52	52			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	9,493,927	9,355,890			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	3,890,396	2,604,515			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	957,346	957,346			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	307,722	173,098			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	13,243,698	10,454,258			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	3,608,346	1,764,093			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	288,924	288,924			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	4,722	-			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	33,337,760	26,770,497			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	21,652	65,879			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	1,420,828	1,042,949			
Contratos Adelantados sobre Euros	51,109	13,377			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	21,463	-			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	-	45,191			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	12,220,361	9,430,921			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	3,977,353	2,063,412			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	1,052,913	1,052,913			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	376,092	376,092			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	9,928,019	9,832,299			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	3,960,247	2,674,365			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	307,722	173,098			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valla de:	\$ 1,257,232	\$ 900,784
Un valor de los activos netos de:	\$ 21,947,207	\$ 12,257,254
El precio de la acción de:	\$ 10.046489	\$ 9.432987

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 55-59, 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	3,479,448	1,791,398
Intereses, dividendos, premios y derechos	276,875	155,337
Resultado cambiario / Otros productos	(10,187)	(2,234)
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	(216,507)	24,231
INGRESOS NETOS	3,529,629	1,968,731
Costo de ventas de valores	3,329,836	1,689,583
Gastos generales	1,544	3,669
Comisiones sobre saldos	52,142	30,035
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	88	-
EGRESOS NETOS	3,383,611	1,723,287
UTILIDAD DE OPERACIÓN	146,018	245,444
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(442,340)	198,217
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	(296,322)	443,661

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