

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

**SIEFORE SURA BASICA 80-84, 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	-	Acreedores	400,933	-
Bancos monedas extranjeras	48,168	-	Provisiones para gastos	4,212	-
Divisas por recibir	807,223	-	Divisas por entregar	812,102	-
	855,402	-	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	4,371,260	-
INVERSIONES			TOTAL PASIVO	5,588,507	-
Inversión en valores de renta variable	14,466,199	-			
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	(1,086,054)	-			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	23,131,525	-			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	1,964,012	-			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	26,528,732	-			
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	517,096	-			
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	2,284,655	-			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	110,766	-			
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	3,175,694	-			
Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	75,391	-			
Inversión en FIBRAS	2,905,895	-			
Plus (Minus) valía en Inversion en FIBRAS	(897,629)	-			
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	721	-			
Inversión en valores extranjeros de deuda	127,188	-			
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	3,576	-			
Inversión en títulos Fiduciarios	5,448,436	-			
Plus (minus) valía en Títulos Fiduciarios	538,792	-			
Valores Prestados	166,788	-			
Plus (Minus) valía de valores prestados	6,528	-			
Inversión en Fondos Mutuos	1,703,951	-			
Plus (Minus) valía de Fondos Mutuos	118,973	-			
	81,291,234	-			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	25,717	-			
Dividendos o derechos por cobrar	72	-			
Intereses devengados sobre valores	797,293	-			
Reportos	1,530,538	-			
Premios por cobrar por préstamo de valores	8	-			
Intereses devengados sobre valores prestados	2,197	-			
Reembolsos y otros intereses	538	-			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	2,015,714	-			
	4,372,078	-			
TOTAL ACTIVO	86,518,713	-			
			CAPITAL CONTABLE	2020	2019
			CAPITAL		
			CAPITAL CONTRIBUIDO	83,633,845	-
			Capital social pagado	88,545,680	-
			Prima en venta de acciones	(4,911,835)	-
			CAPITAL GANADO	(4,055,090)	-
			Resultados de ejercicios anteriores	458,674	-
			Resultados del ejercicio	(4,513,764)	-
			OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
			PLUS (MINUS) VALÍAS	1,351,451	-
			TOTAL CAPITAL CONTABLE	80,930,206	-
			TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	86,518,713	-

CUENTAS DE ORDEN	2020	2019	CUENTAS DE ORDEN	2020	2019
Valores entregados en custodia	80,669,997	-	Capital social autorizado	35,000,100	-
Valores prestados	173,316	-	Acciones emitidas	35,000,100,000	-
Garantías recibidas por valores prestados	180,505	-	Acciones en circulación, posición propia	63,751,240	-
Colaterales recibidos por reportos	1,533,813	-	Acciones de Siefores, posición de terceros	1	-
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	193,764	-	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	8,790,816,743	-
Bancos divisas en moneda extranjera	1,996	-			
Dólares americanos	1,453	-			
Euros	544	-			
Divisas por recibir	34,372	-			
Dólares americanos	34,372	-			
Divisas por entregar	34,580	-			
Dólares americanos	34,580	-			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	5,440,070	-			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	47,656,349	-			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	14,361,079	-			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	5,094,646	-			
Contratos Adelantados sobre Euros	1,810,428	-			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	89,197	-			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	1,077,188	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	2,506,731	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	5,928,244	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	883,393	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	797,340	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	7,261,913	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	6,951,201	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	757,595	-			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	137,394	-			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	40,257,964	-			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	715,714	-			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	12,566,957	-			
Contratos Adelantados sobre Euros	1,448,030	-			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	165,042	-			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	39,733	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	6,411,300	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	8,274,473	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	1,416,521	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	1,142,010	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	1,352,602	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	5,928,244	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	797,340	-			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$	1,351,451	\$	-
Un valor de los activos netos de:	\$	80,930,206	\$	-
El precio de la acción de:	\$	9.139938	\$	-

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 80-84, 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	13,218,066	-
Intereses, dividendos, premios y derechos	1,043,519	-
Resultado cambiario / Otros productos	(80,155)	-
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	(5,503,394)	-
INGRESOS NETOS	8,678,036	-
Costo de ventas de valores	12,986,664	-
Gastos generales	10,599	-
Comisiones sobre saldos	192,983	-
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	1,554	-
EGRESOS NETOS	13,191,800	-
UTILIDAD DE OPERACIÓN	(4,513,764)	-
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(2,669,551)	-
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	(7,183,315)	-

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