

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

**SIEFORE SURA BASICA 85-89, 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	272,102	1,133,355
Bancos monedas extranjeras	75,545	1,098,309	Provisiones para gastos	2,994	15,026
Divisas por recibir	526,189	22,915	Divisas por entregar	544,846	1,065,785
	601,744	1,121,234	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	8,933,229	4,722,247
INVERSIONES			TOTAL PASIVO	9,753,171	6,936,412
Inversión en valores de renta variable	10,191,221	17,723,480			
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	(737,604)	464,835			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	12,775,371	38,302,349			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	1,046,797	2,477,148			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	17,080,393	29,515,930			
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	334,258	(1,061,286)			
Inversiones Tercerizadas	-	3,064,120			
Plus (Minus) valía en inversiones tercerizadas	-	602,977			
Depósito Traspaso Banxico	5,433	2,942	CAPITAL CONTABLE	2020	2019
Plus (Minus) valía en inversión en el Depósito Traspaso Banxico	84	15	CAPITAL		
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	1,495,387	4,509,508	CAPITAL CONTRIBUIDO	(3,636,852)	69,606,241
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	33,831	268,549	Capital social pagado	23,951,466	55,461,518
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	3,298,704	1,835,415	Prima en venta de acciones	(27,588,318)	14,144,724
Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	115,391	(8,894)	CAPITAL GANADO	56,905,832	50,943,815
Inversión en FIBRAS	1,756,666	3,951,664	Resultados de ejercicios anteriores	59,885,630	48,079,485
Plus (Minus) valía en Inversion en FIBRAS	(523,768)	(652,438)	Resultados del ejercicio	(2,979,798)	2,864,330
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	-	12,871	OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	460	-	PLUS (MINUS) VALÍAS	668,980	3,687,095
Inversión en valores extranjeros de deuda	64,945	170,717			
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	1,757	(4,018)	TOTAL CAPITAL CONTABLE	53,937,960	124,237,151
Inversión en títulos Fiduciarios	3,362,958	6,460,105			
Plus (minus) valía en Títulos Fiduciarios	305,383	1,407,236			
Valores Prestados	252,930	6,118,225			
Plus (Minus) valía de valores prestados	10,687	192,971			
Inversión en Fondos Mutuos	1,106,141	-			
Plus (Minus) valía de Fondos Mutuos	82,165	-			
	52,059,589	115,354,420			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	16,731	1,182,858			
Dividendos o derechos por cobrar	40	4,808			
Intereses devengados sobre valores	511,747	1,088,799			
Reportos	3,297,512	8,623,391			
Premios por cobrar por préstamo de valores	12	324			
Intereses devengados sobre valores prestados	4,299	87,588			
Reembolsos y otros intereses	351	-			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	7,199,105	3,710,141			
	11,029,798	14,697,910			
TOTAL ACTIVO	63,691,130	131,173,564	TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	63,691,130	131,173,564

CUENTAS DE ORDEN	2020	2019	CUENTAS DE ORDEN	2020	2019
Valores entregados en custodia	51,795,512	108,782,753	Capital social autorizado	126,259,200	126,259,200
Valores prestados	263,617	6,311,196	Acciones emitidas	25,000,019,801	25,000,019,801
Garantías recibidas por valores prestados	276,513	6,761,391	Acciones en circulación, posición propia	34,093,992	82,769,666
Colaterales recibidos por reportos	3,300,496	-	Acciones de Siefores, posición de terceros	2	2
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	788,160	424,600	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	4,708,428,675	10,898,917,562
Bancos divisas en moneda extranjera	61,859	69,096			
Dólares americanos	2,267	56,078			
Euros	364	434			
Yenes	59,229	12,584			
Divisas por recibir	22,406	1,183			
Dólares americanos	22,406	1,183			
Divisas por entregar	23,200	55,000			
Dólares americanos	23,200	55,000			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	3,516,958	7,204,368			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	228,433,227	247,675,928			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	8,936,335	12,409,420			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	7,349,477	13,665,837			
Contratos Adelantados sobre Euros	1,187,240	2,072,874			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	60,719	-			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	720,462	1,327,024			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Extranjera	-	173,233			
Contratos de Opciones sobre Renta Variable Nacional	-	1,990			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	75,948,223	82,643,638			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	29,184,072	24,445,163			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	3,332,328	4,193,871			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	1,907,095	1,282,303			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	73,263,604	81,734,969			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	24,604,211	21,873,839			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	1,851,766	1,851,766			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	87,696	-			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	223,015,908	234,422,828			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	472,970	2,586,642			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	11,209,932	13,150,525			
Contratos Adelantados sobre Euros	796,455	296,523			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	112,348	-			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	442,719	319,848			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	71,757,998	78,777,250			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	25,217,172	24,570,332			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	3,061,883	4,493,553			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	2,117,968	2,509,034			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	75,910,965	81,167,324			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	30,008,403	25,269,494			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	1,907,095	1,282,303			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$	668,980	\$	3,687,095
Un valor de los activos netos de:	\$	53,937,960	\$	124,237,151
El precio de la acción de:	\$	11.373263	\$	11.313121

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 85-89, 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	8,482,402	7,273,088
Intereses, dividendos, premios y derechos	688,041	1,395,540
Resultado cambiario / Otros productos	(46,832)	(6,818)
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	(3,588,128)	1,724,156
INGRESOS NETOS	5,535,483	10,385,966
Costo de ventas de valores	8,377,786	7,195,622
Gastos generales	9,553	39,988
Comisiones sobre saldos	126,929	281,449
Comisiones por servicios de tercerización	-	4,578
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	1,013	-
EGRESOS NETOS	8,515,281	7,521,636
UTILIDAD DE OPERACIÓN	(2,979,798)	2,864,330
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(1,657,070)	4,327,581
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	(4,636,868)	7,191,912

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