

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

**SIEFORE SURA BASICA INICIAL, 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	25,794	-
Bancos monedas extranjeras	23,828	-	Provisiones para gastos	286	-
Divisas por recibir	54,009	-	Divisas por entregar	54,099	-
	77,847	-	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	365,945	-
INVERSIONES			TOTAL PASIVO	446,125	-
Inversión en valores de renta variable	965,969	-			
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	(71,943)	-			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	1,416,098	-			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	113,528	-			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	1,712,017	-			
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	32,255	-			
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	152,273	-			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	4,201	-			
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	251,294	-			
Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	7,154	-			
Inversión en FIBRAS	173,550	-			
Plus (Minus) valía en Inversion en FIBRAS	(51,746)	-			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	966	-			
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	46	-			
Inversión en valores extranjeros de deuda	8,239	-			
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	(145)	-			
Inversión en títulos Fiduciarios	340,572	-			
Plus (minus) valía en Títulos Fiduciarios	30,467	-			
Valores Prestados	91,110	-			
Plus (Minus) valía de valores prestados	4,487	-			
Inversión en Fondos Mutuos	110,846	-			
Plus (Minus) valía de Fondos Mutuos	7,739	-			
	5,298,978	-			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	1,765	-			
Dividendos o derechos por cobrar	5	-			
Intereses devengados sobre valores	51,365	-			
Reportos	234,921	-			
Premios por cobrar por préstamo de valores	5	-			
Intereses devengados sobre valores prestados	319	-			
Reembolsos y otros intereses	35	-			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	180,368	-			
	468,783	-			
TOTAL ACTIVO	5,845,607	-			
			CAPITAL CONTABLE	2020	2019
			CAPITAL		
			CAPITAL CONTRIBUIDO	5,620,722	-
			Capital social pagado	5,932,819	-
			Prima en venta de acciones	(312,097)	-
			CAPITAL GANADO	(297,237)	-
			Resultados de ejercicios anteriores	28,698	-
			Resultados del ejercicio	(325,935)	-
			OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
			PLUS (MINUS) VALÍAS	75,998	-
			TOTAL CAPITAL CONTABLE	5,399,483	-
			TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	5,845,607	-

CUENTAS DE ORDEN	2020	2019	CUENTAS DE ORDEN	2020	2019
Valores entregados en custodia	5,157,358	-	Capital social autorizado	35,000,100	-
Valores prestados	95,597	-	Acciones emitidas	35,000,100,000	-
Garantías recibidas por valores prestados	97,530	-	Acciones en circulación, posición propia	3,453,720	-
Colaterales recibidos por reportos	235,423	-	Acciones de Siefores, posición de terceros	1	-
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	18,748	-	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	476,295,084	-
Bancos divisas en moneda extranjera	935	-			
Dólares americanos	143	-			
Euros	792	-			
Divisas por recibir	2,300	-			
Dólares americanos	2,300	-			
Divisas por entregar	2,304	-			
Dólares americanos	2,304	-			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	372,139	-			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	3,734,459	-			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	939,389	-			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	275,437	-			
Contratos Adelantados sobre Euros	104,193	-			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	6,158	-			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	71,936	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	918,557	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	432,299	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	129,273	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	523,000	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	325,466	-			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	8,752	-			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	3,366,114	-			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	47,510	-			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	853,154	-			
Contratos Adelantados sobre Euros	79,523	-			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	11,394	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	410,800	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	420,544	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	156,008	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	29,521	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	925,360	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	432,299	-			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valla de:	\$	75,998	\$	-
Un valor de los activos netos de:	\$	5,399,483	\$	-
El precio de la acción de:	\$	11.254813	\$	-

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 INICIAL, 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	828,828	-
Intereses, dividendos, premios y derechos	68,737	-
Resultado cambiario / Otros productos	(851)	-
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	(393,912)	-
INGRESOS NETOS	502,801	-
Costo de ventas de valores	815,256	-
Gastos generales	734	-
Comisiones sobre saldos	12,645	-
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	101	-
EGRESOS NETOS	828,736	-
UTILIDAD DE OPERACIÓN	(325,935)	-
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(166,595)	-
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	(492,530)	-

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