

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

**SIEFORE SURA BASICA 60-64, 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	11	11	Acreedores	486,319	1,123,319
Bancos monedas extranjeras	83,001	811,368	Provisiones para gastos	2,981	22,179
Divisas por recibir	360,140	40,101	Divisas por entregar	383,629	794,494
	443,151	851,479	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	10,044,559	5,162,507
RESERVADOS			TOTAL PASIVO	10,917,488	7,102,499
Bancos Moneda Extr., Depósitos reserv. al pago compromisos futuros en divisas	219,089	-			
	219,089	-			
INVERSIONES			CAPITAL CONTABLE	2020	2019
Inversión en valores de renta variable	8,258,693	22,980,053	CAPITAL		
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	(562,740)	1,322,915	CAPITAL CONTRIBUIDO		
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	20,158,826	75,850,813	Capital social pagado	6,338,170	20,471,482
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	2,063,025	6,518,767	Prima en venta de acciones	(67,727,222)	63,664,181
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	21,496,916	51,425,595	CAPITAL GANADO	125,947,615	114,107,674
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	348,767	(2,163,269)	Resultados de ejercicios anteriores	127,429,042	110,415,764
Inversiones Tercerizadas	-	3,250,938	Resultados del ejercicio	(1,481,427)	3,691,911
Plus (Minus) valía en inversiones tercerizadas	-	633,075	OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
Depósito Traspaso Banxico	214,282	414,466	PLUS (MINUS) VALÍAS	2,063,901	8,417,097
Plus (Minus) valía en inversión en el Depósito Traspaso Banxico	3,313	2,178	TOTAL CAPITAL CONTABLE	66,622,464	206,660,434
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	1,997,534	8,281,672			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	248,370	673,173			
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	3,476,506	2,649,171			
Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	119,924	(53,937)			
Inversión en FIBRAS	1,788,671	6,494,417			
Plus (Minus) valía en Inversion en FIBRAS	(571,808)	(1,155,273)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	-	15,993			
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	317	-			
Inversión en valores extranjeros de deuda	145,426	518,916			
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	6,432	(15,470)			
Inversión en títulos Fiduciarios	2,913,130	9,498,602			
Plus (minus) valía en Títulos Fiduciarios	346,514	2,314,849			
Valores Prestados	18,504	10,103,721			
Plus (Minus) valía de valores prestados	615	340,088			
Inversión en Fondos Mutuos	827,807	-			
Plus (Minus) valía de Fondos Mutuos	61,490	-			
	63,360,513	199,901,453			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	14,299	992,167			
Dividendos o derechos por cobrar	29	8,571			
Intereses devengados sobre valores	724,825	2,050,653			
Reportos	3,939,639	6,404,017			
Premios por cobrar por préstamo de valores	3	474			
Intereses devengados sobre valores prestados	64	156,372			
Reembolsos y otros intereses	263	-			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	8,838,076	3,397,746			
	13,517,198	13,010,000			
TOTAL ACTIVO	77,539,952	213,762,932	TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	77,539,952	213,762,932

CUENTAS DE ORDEN	2020	2019	CUENTAS DE ORDEN	2020	2019
Valores entregados en custodia	63,088,057	188,802,451	Capital social autorizado	27,500,100	27,500,100
Valores prestados	19,119	10,443,809	Acciones emitidas	27,500,100,000	27,500,100,000
Garantías recibidas por valores prestados	19,793	11,220,232	Acciones en circulación, posición propia	47,359,960	151,659,526
Colaterales recibidos por reportos	3,949,539	-	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	6,290,809,616	20,319,822,230
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	1,096,462	462,983			
Bancos divisas en moneda extranjera	59,048	58,333			
Dólares americanos	2,362	40,719			
Euros	592	893			
Yenes	56,093	16,721			
Divisas por recibir	15,335	2,069			
Dólares americanos	15,335	2,069			
Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en moneda extranjera	9,329	-			
Dólares americanos	9,329	-			
Divisas por entregar	16,335	41,000			
Dólares americanos	16,335	41,000			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	3,149,949	8,560,488			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	297,668,867	315,259,359			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	5,942,971	13,221,125			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	8,938,290	22,535,883			
Contratos Adelantados sobre Euros	1,195,857	2,598,474			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	53,062	-			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	132,804	-			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Extranjera	-	58,676			
Contratos de Opciones sobre Renta Variable Nacional	-	3,101			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	93,989,792	94,600,467			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	41,680,432	34,212,873			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	2,477,493	3,250,080			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	3,537,339	2,247,090			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	98,506,903	103,619,543			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	37,798,073	35,593,724			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	3,355,369	3,318,322			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	60,483	-			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	291,930,667	297,983,064			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	342,197	3,115,628			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	8,982,233	16,194,920			
Contratos Adelantados sobre Euros	778,343	370,096			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	98,181	-			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	-	999,280			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	320,253	309,853			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	94,718,474	98,695,654			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	39,334,766	39,423,261			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	3,212,648	5,049,284			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	3,874,347	4,296,034			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	94,122,073	92,139,709			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	42,609,813	35,142,254			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	3,537,339	2,247,090			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$	2,063,901	\$	8,417,097
Un valor de los activos netos de:	\$	66,622,464	\$	206,660,434
El precio de la acción de:	\$	10.511310	\$	10.095040

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 60-64, 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	8,553,735	12,445,905
Intereses, dividendos, premios y derechos	899,794	2,462,307
Resultado cambiario / Otros productos	(45,823)	(57,729)
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	(2,370,313)	1,492,851
INGRESOS NETOS	7,037,393	16,343,334
Costo de ventas de valores	8,352,197	12,110,201
Gastos generales	9,176	52,783
Comisiones sobre saldos	156,689	483,582
Comisiones por servicios de tercerización	-	4,857
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	758	-
EGRESOS NETOS	8,518,820	12,651,423
UTILIDAD DE OPERACIÓN	(1,481,427)	3,691,911
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(1,650,560)	6,712,084
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	(3,131,987)	10,403,994

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