

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

**SIEFORE SURA BASICA 90-94, 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	275,685	-
Bancos monedas extranjeras	24,470	-	Provisiones para gastos	1,304	-
Divisas por recibir	260,761	-	Divisas por entregar	254,066	-
	285,241	-	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	1,369,856	-
RESERVADOS			TOTAL PASIVO	1,900,911	-
Bancos Moneda Extr., Depósitos reserv. al pago compromisos futuros en divisas	147,591	-			
	147,591	-			
INVERSIONES			CAPITAL CONTABLE	2020	2019
Inversión en valores de renta variable	4,467,308	-	CAPITAL		
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	(340,970)	-	CAPITAL CONTRIBUIDO	26,349,275	-
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	6,880,567	-	Capital social pagado	27,819,261	-
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	551,304	-	Prima en venta de acciones	(1,469,986)	-
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	8,373,194	-	CAPITAL GANADO	(1,293,942)	-
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	164,172	-	Resultados de ejercicios anteriores	122,675	-
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	721,366	-	Resultados del ejercicio	(1,416,618)	-
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	22,844	-	OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	1,029,943	-	PLUS (MINUS) VALÍAS	351,920	-
Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	22,999	-			
Inversión en FIBRAS	867,750	-	TOTAL CAPITAL CONTABLE	25,407,252	-
Plus (Minus) valía en Inversion en FIBRAS	(258,729)	-			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	10,268	-			
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	213	-			
Inversión en valores extranjeros de deuda	34,621	-			
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	1,599	-			
Inversión en títulos Fiduciarios	1,566,218	-			
Plus (minus) valía en Títulos Fiduciarios	142,234	-			
Valores Prestados	313,595	-			
Plus (Minus) valía de valores prestados	10,489	-			
Inversión en Fondos Mutuos	515,267	-			
Plus (Minus) valía de Fondos Mutuos	35,977	-			
	25,132,231	-			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	8,520	-			
Dividendos o derechos por cobrar	21	-			
Intereses devengados sobre valores	243,905	-			
Reportos	898,773	-			
Premios por cobrar por préstamo de valores	15	-			
Intereses devengados sobre valores prestados	5,640	-			
Reembolsos y otros intereses	163	-			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	586,063	-			
	1,743,101	-			
TOTAL ACTIVO	27,308,164	-	TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	27,308,164	-

CUENTAS DE ORDEN	2020	2019	CUENTAS DE ORDEN	2020	2019
Valores entregados en custodia	24,579,465	-	Capital social autorizado	35,000,100	-
Valores prestados	324,085	-	Acciones emitidas	35,000,100,000	-
Garantías recibidas por valores prestados	340,862	-	Acciones en circulación, posición propia	16,196,884	-
Colaterales recibidos por reportos	900,696	-	Acciones de Siefores, posición de terceros	1	-
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	48,426	-	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	2,233,367,352	-
Bancos divisas en moneda extranjera	974	-			
Dólares americanos	298	-			
Euros	676	-			
Divisas por recibir	11,103	-			
Dólares americanos	11,103	-			
Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en moneda extranjera	6,285	-			
Dólares americanos	6,285	-			
Divisas por entregar	10,818	-			
Dólares americanos	10,818	-			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	1,641,375	-			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	17,535,918	-			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	4,470,848	-			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	1,249,920	-			
Contratos Adelantados sobre Euros	548,439	-			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	28,626	-			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	334,223	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	2,977,310	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	2,104,070	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	398,693	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	1,278	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	3,094,950	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	2,286,880	-			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	40,682	-			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	15,184,369	-			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	221,435	-			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	3,513,051	-			
Contratos Adelantados sobre Euros	375,653	-			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	52,966	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	2,605,650	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	2,749,989	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	702,414	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	141,493	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	2,716,370	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	2,104,070	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	1,278	-			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$	351,920	\$	-
Un valor de los activos netos de:	\$	25,407,252	\$	-
El precio de la acción de:	\$	11.294300	\$	-

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 90-94, 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	3,528,472	-
Intereses, dividendos, premios y derechos	329,923	-
Resultado cambiario / Otros productos	(19,793)	-
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	(1,716,620)	-
INGRESOS NETOS	2,121,982	-
Costo de ventas de valores	3,475,885	-
Gastos generales	3,003	-
Comisiones sobre saldos	59,242	-
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	470	-
EGRESOS NETOS	3,538,599	-
UTILIDAD DE OPERACIÓN	(1,416,618)	-
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(790,447)	-
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	(2,207,064)	-

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