

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

**SIEFORE SURA BASICA 70-74, 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	817,887	-
Bancos monedas extranjeras	66,353	-	Provisiones para gastos	4,921	-
Divisas por recibir	761,055	-	Divisas por entregar	776,303	-
	827,418	-	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	5,005,017	-
RESERVADOS			TOTAL PASIVO	6,604,128	-
Bancos Moneda Extr., Depósitos reserv. al pago compromisos futuros en divisas	445,094	-			
	445,094	-			
INVERSIONES			CAPITAL CONTABLE	2020	2019
Inversión en valores de renta variable	14,374,601	-	CAPITAL		
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	(1,101,861)	-	CAPITAL CONTRIBUIDO	110,907,108	-
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	37,102,183	-	Capital social pagado	118,868,615	-
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	3,844,174	-	Prima en venta de acciones	(7,961,507)	-
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	35,644,638	-	CAPITAL GANADO	(2,767,328)	-
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	555,839	-	Resultados de ejercicios anteriores	611,322	-
Depósito Traspaso Banxico	63,355	-	Resultados del ejercicio	(3,378,650)	-
Plus (Minus) valía en inversión en el Depósito Traspaso Banxico	980	-	OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	3,409,011	-	PLUS (MINUS) VALÍAS	3,570,585	-
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	390,345	-	TOTAL CAPITAL CONTABLE	111,710,365	-
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	3,447,297	-			
Plus (Minus) valía en instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	121,485	-			
Inversión en FIBRAS	3,897,070	-			
Plus (Minus) valía en Inversión en FIBRAS	(1,240,214)	-			
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	660	-			
Inversión en valores extranjeros de deuda	320,649	-			
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	6,531	-			
Inversión en títulos Fiduciarios	7,618,869	-			
Plus (minus) valía en Títulos Fiduciarios	869,950	-			
Valores Prestados	277,177	-			
Plus (Minus) valía de valores prestados	8,669	-			
Inversión en Fondos Mutuos	1,642,594	-			
Plus (Minus) valía de Fondos Mutuos	114,689	-			
	111,368,689	-			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	25,007	-			
Dividendos o derechos por cobrar	72	-			
Intereses devengados sobre valores	1,193,900	-			
Reportos	1,752,470	-			
Premios por cobrar por préstamo de valores	10	-			
Intereses devengados sobre valores prestados	5,512	-			
Reembolsos y otros intereses	519	-			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	2,695,800	-			
	5,673,292	-			
TOTAL ACTIVO	118,314,493	-	TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	118,314,493	-

CUENTAS DE ORDEN	2020	2019	CUENTAS DE ORDEN	2020	2019
Valores entregados en custodia	111,082,183	-	Capital social autorizado	35,000,100	-
Valores prestados	285,846	-	Acciones emitidas	35,000,100,000	-
Garantías recibidas por valores prestados	301,898	-	Acciones en circulación, posición propia	87,854,081	-
Colaterales recibidos por reportos	1,756,665	-	Acciones de Siefores, posición de terceros	1	-
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	578,371	-	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	11,799,007,433	-
Bancos divisas en moneda extranjera	2,740	-			
Dólares americanos	1,894	-			
Euros	846	-			
Divisas por recibir	32,406	-			
Dólares americanos	32,406	-			
Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en moneda extranjera	18,953	-			
Dólares americanos	18,953	-			
Divisas por entregar	33,056	-			
Dólares americanos	33,056	-			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	6,804,940	-			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	58,114,194	-			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	13,912,906	-			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	7,620,299	-			
Contratos Adelantados sobre Euros	1,932,074	-			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	97,686	-			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	429,769	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	5,360,871	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	7,685,945	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	754,025	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	126,648	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	10,489,359	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	9,394,535	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	184,293	-			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	125,783	-			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	49,885,505	-			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	687,953	-			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	13,235,068	-			
Contratos Adelantados sobre Euros	1,389,894	-			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	180,750	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	10,315,600	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	10,550,644	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	1,792,702	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	450,416	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	3,469,886	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	7,685,945	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	126,648	-			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$	3,570,585	\$	-
Un valor de los activos netos de:	\$	111,710,365	\$	-
El precio de la acción de:	\$	9.397802	\$	-

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 70-74, 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	14,722,748	-
Intereses, dividendos, premios y derechos	1,480,395	-
Resultado cambiario / Otros productos	(83,712)	-
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	(4,891,615)	-
INGRESOS NETOS	11,227,816	-
Costo de ventas de valores	14,329,449	-
Gastos generales	11,113	-
Comisiones sobre saldos	264,406	-
Comisiones por gestión de Fondos Mutuos	1,498	-
EGRESOS NETOS	14,606,466	-
UTILIDAD DE OPERACIÓN	(3,378,650)	-
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(3,252,097)	-
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	(6,630,747)	-

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