

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

**SIEFORE SURA BÁSICA 1, 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 DICIEMBRE DE 2017 Y 2016

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2017	2016	PASIVO	2017	2016
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	11	10	Acreedores	143,903	3,418
Bancos monedas extranjeras	32,013	125,469	Provisiones para gastos	1,405	1,183
	32,024	125,479	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	1,084,905	1,360,134
INVERSIONES			TOTAL PASIVO	1,230,213	1,364,735
Inversión en valores de renta variable	440,192	280,920			
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	100,247	200,090			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	5,523,935	5,932,112			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	742,037	883,516			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	3,426,318	3,266,241			
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(148,955)	(206,259)			
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	533,507	632,000			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	144,282	186,387			
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	160,806	156,516			
Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	9,965	7,304			
Inversión en FIBRAS	2,759				
Plus (Minus) valía en Inversion en FIBRAS	(28)				
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	3,631	7,834			
Inversión en valores extranjeros de deuda	252,367	481,503			
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	46,207	43,158			
Inversión en instrumentos de deuda por reporto	800,726	805,660			
Plus (Minus) valía de valores por reporto	1,183	988			
Valores Prestados	223,736				
Plus (Minus) valía de valores prestados	(14,102)				
	12,248,813	12,677,970			
DEUDORES DIVERSOS			CAPITAL CONTABLE	2017	2016
Liquidadora	27	35,627	CAPITAL		
Dividendos o derechos por cobrar		3	CAPITAL CONTRIBUIDO	1,389,054	2,999,078
Intereses devengados sobre valores	91,721	84,267	Capital social pagado	4,927,905	5,583,756
Reportos	(1,195)	(992)	Prima en venta de acciones	(3,538,851)	(2,584,678)
Premios por cobrar por préstamo de valores	9				
Intereses devengados por instrumentos recibidos en reporto	4,233	9,100			
Intereses devengados sobre valores prestados	881				
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	993,513	1,315,375			
	1,089,189	1,443,380	CAPITAL GANADO	9,871,107	8,768,821
			Resultados de ejercicios anteriores	8,768,821	8,386,593
			Resultados del ejercicio	1,102,286	382,228
			OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
			PLUS (MINUS) VALÍAS	879,652	1,114,195
			TOTAL CAPITAL CONTABLE	12,139,813	12,882,094
TOTAL ACTIVO	13,370,026	14,246,829	TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	13,370,026	14,246,829

CUENTAS DE ORDEN	2017	2016	CUENTAS DE ORDEN	2017	2016
Valores entregados en custodia	11,233,638	11,863,487	Capital social autorizado	11,354,689	11,354,689
Valores entregados en custodia por reporto	804,947	814,756	Acciones emitidas	3,200,028,183	3,200,028,183
Valores prestados	209,634				
Garantías recibidas por valores prestados	221,779				
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	72,185	16,539	Acciones en circulación, posición propia	10,896,418	12,050,709
Bancos divisas en moneda extranjera	1,903	5,794	Acciones de Siefores, posición de terceros	1,127	1,127
Dólares americanos	1,316	278	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	1,377,906,351	1,561,586,780
Euros	258	5,516			
Yenes	329	-			
Divisas por recibir	-	-			
Dólares americanos	-	-			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	38,197,888	40,717,549			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	166,974	31,629			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	1,410,337	1,287,618			
Contratos Adelantados sobre Euros	73,712	37,019			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas		13,920			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional		9,803			
Contratos Opc. Renta Variable Nacional	65				
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	13,032,179	13,150,846			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	3,702,156	4,618,715			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	1,108,474	1,379,564			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	13,929,394	14,809,071			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	4,485,673	5,379,364			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	288,924				
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	37,710,576	41,462,489			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera		24,788			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	680,985	1,811,325			
Contratos Adelantados sobre Euros	117,232	-			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	75,469	34,331			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	13,978				
Contratos Futuros sobre Renta Variable Extranjera		73,806			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	276,454	146,146			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	12,742,817	13,156,137			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	4,411,226	5,207,443			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	1,577,088	2,023,853			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	387,298	145,980			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	13,601,142	14,095,234			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	3,826,887	4,743,446			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$	879,652	\$	1,114,195
Un valor de los activos netos de:	\$	12,139,813	\$	12,882,094
El precio de la acción de:	\$	8.741200	\$	8.186183

GABRIEL VILLAGÓMEZ GÓMEZ
Contador General de SIEFORE

ENRIQUE SOLÓRZANO PALACIO
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 BÁSICA 1, S.A. DE C.V., SOCIEDAD DE INVERSIÓN ESPECIALIZADA DE FONDOS PARA EL RETIRO SOCIEDAD DE INVERSIÓN BÁSICA

ESTADOS DE RESULTADOS INTEGRAL POR LOS PERIODOS DEL 1 DE ENERO AL 31 DE DICIEMBRE DE 2017 Y 2016

(Cifras en miles de pesos)

	2017	2016
Ingresos por la venta de Valores	6,967,424	3,802,908
Intereses, dividendos, premios y derechos	600,851	739,170
Resultado cambiario / Otros productos	(21,444)	(1,519)
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	29,530	(302,383)
INGRESOS NETOS	7,576,361	4,238,176
Costo de ventas de valores	6,327,390	3,663,164
Gastos generales	5,553	8,955
Comisiones sobre saldos	118,415	150,020
Intereses sobre inversiones en valores a entregar	22,717	33,809
EGRESOS NETOS	6,474,075	3,855,948
UTILIDAD DE OPERACIÓN	1,102,286	382,228
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(234,543)	34,585
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	867,743	416,813

GABRIEL VILLAGÓMEZ GÓMEZ

Contador General de SIEFORE

ENRIQUE SOLÓRZANO PALACIO

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 7 de Noviembre de 2017, fueron aprobados los Estados Financieros al 30 de Septiembre de 2017 y 2016, asimismo, los presentes Estados Financieros al 31 Diciembre de 2017 y 2016 fueron aprobados en la Sesión del Consejo de Administración con fecha 28 de Febrero de 2018.