

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 MARZO DE 2018 Y 2017

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2018	2017	PASIVO	2018	2017
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	9	232	Acreeedores	5,428	160,032
Bancos monedas extranjeras	24,125	291,996	Divisas por entregar	-	315,937
Divisas por recibir	152	79,451	Provisiones para gastos	1,636	1,179
	24,286	371,679	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	853,441	1,211,506
INVERSIONES	-	-			
Inversión en valores de renta variable	542,315	337,206	TOTAL PASIVO	860,505	1,688,654
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	54,297	190,147			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	5,721,258	5,667,671	CAPITAL CONTABLE	2018	2017
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	749,269	834,177	CAPITAL		
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	2,879,781	2,765,447	CAPITAL CONTRIBUIDO	355,396	1,437,081
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(85,440)	(69,011)	Capital social pagado	4,509,805	4,915,227
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	501,802	473,661	Prima en venta de acciones	(4,154,409)	(3,478,146)
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	78,531	97,480			
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	218,580	131,112	CAPITAL GANADO	10,028,582	9,042,092
Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	9,701	6,040	Resultados de ejercicios anteriores	9,871,107	8,768,821
Inversión en FIBRAS	2,759		Resultados del ejercicio	157,475	273,271
Plus(Minus)valia en inversión de FIBRAS	(28)				
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	840	2,983	OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
Inversión en valores extranjeros de deuda	164,120	346,022	PLUS (MINUS) VALÍAS	831,167	1,094,397
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	25,134	40,220			
Inversión en instrumentos de deuda por reporto	90,527	228,421	TOTAL CAPITAL CONTABLE	11,215,145	11,573,570
Plus (Minus) valía de valores por reporto	157	456			
Valores Prestados	202,409	107,608			
Plus (Minus) valía de valores prestados	(297)	(4,657)			
	11,155,715	11,154,983			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	16,990	386,056			
Dividendos o derechos por cobrar	6	489			
Intereses devengados sobre valores	130,623	139,087			
Reportos	(156)	(455)			
Premios por cobrar por préstamo de valores	8	3			
Intereses devengados por instrumentos recibidos en reporto	343	165			
Intereses devengados sobre valores prestados	4,100	1,835			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	743,735	1,208,382			
	895,649	1,735,562			
	-	-			
TOTAL ACTIVO	12,075,650	13,262,224	TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	12,075,650	13,262,224

Cuentas de Orden	2018	2017	Cuentas de Orden	2018	2017
Valores entregados en custodia	10,805,279	10,820,173	Capital social autorizado	11,354,689	11,354,689
Valores entregados en custodia por reporto	90,870	228,587	Acciones emitidas	3,200,028,183	3,200,028,183
Valores prestados	202,112	102,951	Acciones en circulación, posición propia	10,896,419	12,050,709
Garantías recibidas por préstamo de valores	210,826	111,196	Acciones de Siefos, posición de terceros	1,127	1,127
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	28,715	68	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	1,260,075,578	1,373,179,145
Bancos divisas en moneda extranjera	8,061	15,567			
Dólares americanos	794	13,130			
Euros	375	2,254			
Yenes	6,892	183			
Divisas por recibir	8	4,227			
Dólares americanos	8	4,227			
Divisas por entregar	-	16,809			
Dólares americanos	-	16,809			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	33,846,781	45,291,173			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	170,726	32,774			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	1,447,607	2,793,875			
Contratos Adelantados sobre Euros	6,864	43,470			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	-	5,208			
Ctos.Opc./Rta.Variable Nac.	65				
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	11,925,027	14,074,646			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	2,468,813	4,958,687			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	1,108,474	1,379,564			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	13,586,559	16,090,464			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	2,843,722	5,912,485			
Ctos.Swp./T.Var.Euros	288,924				
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	32,987,271	45,811,610			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	8,076	9,253			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	598,062	2,779,005			
Contratos Adelantados sobre Euros	20,532	185,403			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	38,352	49,782			
Ctos.Fut./Rta.Variable Nac.	14,283				
Contratos Futuros sobre Renta Variable Extranjera	-	77,986			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	-	259,560			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	12,381,543	14,496,137			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	2,825,723	5,740,564			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	1,584,194	2,023,853			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	387,298	87,616			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	12,488,418	15,019,033			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	2,640,790	5,083,418			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$	831,167	\$	1,094,397
Un valor de los activos netos de:	\$	11,215,145	\$	11,573,570
El precio de la acción de:	\$	8.824061	\$	8.354975

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 MARZO DE 2018 Y 2017

(Cifras en miles de pesos)

	2018	2017
Ingresos por la venta de Valores	1,158,188	2,211,966
Intereses, dividendos, premios y derechos	151,250	166,262
Resultado cambiario / Otros productos	(2,608)	(18,384)
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	8,905	64,122
INGRESOS NETOS	1,315,735	2,423,966
Costo de ventas de valores	1,121,826	2,107,765
Gastos generales	1,672	1,144
Comisiones sobre saldos	29,533	31,744
Intereses sobre inversiones en valores a entregar	5,229	10,042
EGRESOS NETOS	1,158,260	2,150,695
UTILIDAD DE OPERACIÓN	157,475	273,271
OTROS RESULTADOS INTEGRALES PLUS (MINUS) VALÍAS	(48,485)	(19,798)
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	108,990	253,473

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 28 de Febrero de 2018, fueron aprobados los Estados Financieros al 31 de Diciembre de 2017, asimismo, los presentes Estados Financieros al 31 de Marzo de 2018 serán aprobados en la Sesión del Consejo de Administración que se llevará a cabo el próximo 23 de Mayo de 2018.