

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 30 DE SEPTIEMBRE DE 2016 Y 2015

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2016	2015	PASIVO	2016	2015
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	11	10	Divisas por entregar	26,825	-
Bancos monedas extranjeras	309,039	47,962	Acreedores	166,834	-
Divisas por recibir	161,803	-	Provisiones para gastos	1,278	407
	470,853	47,972	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	1,283,911	1,175,998
INVERSIONES			TOTAL PASIVO	1,478,848	1,176,405
Inversión en valores de renta variable	292,752	351,920	CAPITAL CONTABLE	2016	2015
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	202,893	171,308	CAPITAL		
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	6,682,325	5,697,947	CAPITAL CONTRIBUIDO	4,272,095	3,760,987
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	956,767	869,179	Capital social pagado	6,154,283	5,920,004
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	4,150,170	4,220,284	Prima en venta de acciones	(1,882,188)	(2,159,017)
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	80,568	102,891	CAPITAL GANADO	8,706,250	8,154,301
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	557,185	377,410	Resultados de ejercicios anteriores	8,386,593	7,708,277
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	185,085	87,371	Resultados del ejercicio	319,657	446,024
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	-	19,306	OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	-	60	PLUS (MINUS) VALÍAS	1,471,273	1,290,139
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	31,262	33,100	TOTAL CAPITAL CONTABLE	14,449,618	13,205,427
Inversión en valores extranjeros de deuda	322,642	531,412			
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	45,960	59,260			
Inversión en instrumentos de deuda por reporto	609,210	644,800			
Plus (Minus) valía de valores por reporto	1,026	1,283			
Valores prestados	-	34,889			
Plus (Minus) valía de valores prestados	-	71			
	14,117,845	13,202,491			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	27,338	231			
Dividendos o derechos por cobrar	549	778			
Intereses devengados sobre valores	181,328	168,068			
Reportos	(1,004)	(1,283)			
Premios por cobrar por prestamo de valores	-	2			
Intereses devengados por instrumentos recibidos en reporto	294	675			
Intereses devengados sobre valores prestados	-	511			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	1,131,263	962,387			
	1,339,768	1,131,369			
TOTAL ACTIVO	15,928,466	14,381,832	TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	15,928,466	14,381,832

CUENTAS DE ORDEN	2016	2015	CUENTAS DE ORDEN	2016	2015
Valores entregados en custodia	13,476,347	12,488,347	Capital social autorizado	11,354,689	11,354,689
Valores entregados en custodia por reporte	609,526	645,476	Acciones emitidas	3,200,028,183	3,200,028,183
Valores prestados	-	34,960	Acciones en circulación, posición propia	15,053,855	15,053,855
Garantías recibidas por valores prestados	-	37,399	Acciones de Siefores, posición de terceros	1,127	1,127
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	16,340	-	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	1,719,372,143	1,653,346,777
Bancos divisas en moneda extranjera	15,762	18,441			
Dólares americanos	9,883	2,541			
Euros	5,393	148			
Yenes	486	15,752			
Divisas por recibir	8,350	-			
Dólares americanos	8,350	-			
Divisas por entregar	1,384	-			
Dólares americanos	1,384	-			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	39,382,992	35,322,140			
Contratos Adelantados sobre Renta Fija (Bonos)	-	191,759			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	28,655	58,828			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	825,728	82,356			
Contratos Adelantados sobre Euros	37,019	145,466			
Contratos Adelantados sobre Yenes	-	1,118			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	103,014	-			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	9,734	9,114			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	12,511,965	11,000,212			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	4,600,989	3,046,260			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	1,379,564	1,356,968			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	14,574,271	14,606,465			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	5,312,053	4,823,594			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	40,712,623	36,484,687			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	21,495	15,255			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	2,026,467	823,824			
Contratos Adelantados sobre Euros	-	309,450			
Contratos Adelantados sobre Yenes	-	751			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	129,502	-			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Extranjera	28,148	-			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	132,539	503,296			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	12,941,337	13,004,167			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	5,123,065	4,591,706			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	1,964,850	1,879,079			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	145,980	204,344			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	13,473,520	11,932,365			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	4,725,720	3,220,450			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$ 1,471,273	\$ 1,290,139
Un valor de los activos netos de:	\$ 14,449,618	\$ 13,205,427
El precio de la acción de:	\$ 8.331061	\$ 7.915017

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 30 DE SEPTIEMBRE DE 2016 Y 2015

(Cifras en miles de pesos)

	2016	2015
Ingresos por la venta de Valores	2,146,435	2,776,894
Intereses, dividendos, premios y derechos	559,165	534,069
Resultado cambiario / Otros productos	1,649	69,330
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	(261,893)	(272,119)
INGRESOS NETOS	2,445,356	3,108,174
Costo de ventas de valores	1,984,086	2,535,068
Gastos generales	894	819
Comisiones sobre saldos	114,332	113,647
Intereses sobre inversiones en valores a entregar	26,387	12,616
EGRESOS NETOS	2,125,699	2,662,150
UTILIDAD DE OPERACIÓN	319,657	446,024
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	391,662	(395,860)
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	711,319	50,164

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.

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS:

En la Sesión del Consejo de Administración con fecha 11 de agosto de 2016, fueron aprobados los Estados Financieros al 30 de junio de 2016 y 2015, asimismo, los presentes Estados Financieros al 30 de septiembre de 2016 y 2015 serán aprobados en la Sesión del Consejo de Administración que se llevará a cabo el próximo 6 de diciembre de 2016.