

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 JUNIO DE 2018 Y 2017

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2018	2017	PASIVO	2018	2017
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	10	10	Acreedores	39,670	1,354
Bancos monedas extranjeras	15,048	81,752	Provisiones para gastos	928	964
Divisas por recibir		27,930	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	906,797	1,009,150
	15,058	109,692			
			TOTAL PASIVO	947,395	1,011,468
INVERSIONES					
Inversión en valores de renta variable	554,820	285,960	CAPITAL CONTABLE		
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	73,751	101,769		2017	2017
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	5,659,219	5,619,292	CAPITAL		
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	706,380	878,642	CAPITAL CONTRIBUIDO	(408,141)	454,731
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	2,523,251	2,198,735	Capital social pagado	4,205,663	4,501,437
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(89,210)	(13,752)	Prima en venta de acciones	(4,613,804)	(4,046,706)
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	462,186	359,160	CAPITAL GANADO	10,260,760	9,280,514
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	100,795	69,202	Resultados de ejercicios anteriores	9,871,107	8,768,821
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	213,793	120,090	Resultados del ejercicio	389,653	511,693
Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	7,797	6,423	OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
Inversión en FIBRAS	2,759		PLUS (MINUS) VALÍAS	804,317	1,078,431
Plus (Minus) valía en Inversion en FIBRAS	(81)		TOTAL CAPITAL CONTABLE	10,656,936	10,813,676
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	2,306	11,236			
Inversión en valores extranjeros de deuda	164,120	318,035			
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	23,020	43,521			
Inversión en instrumentos de deuda por reporto	64,540	147,303			
Plus (Minus) valía de valores por reporto	72	275			
Valores Prestados	241,784	412,710			
Plus (Minus) valía de valores prestados	(18,135)	(7,375)			
	10,693,167	10,551,226			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	51,198				
Dividendos o derechos por cobrar	207	558			
Intereses devengados sobre valores	78,030	68,305			
Reportos	(72)	(270)			
Premios por cobrar por préstamo de valores	9	13			
Intereses devengados por instrumentos recibidos en reporto	154	1,856			
Intereses devengados sobre valores prestados	844	3,160			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	765,736	1,090,604			
	896,106	1,164,226			
TOTAL ACTIVO	11,604,331	11,825,144	TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	11,604,331	11,825,144

CUENTAS DE ORDEN	2018	2017	CUENTAS DE ORDEN	2018	2017
Valores entregados en custodia	10,371,200	9,987,077	Capital social autorizado	11,354,689	11,354,689
Valores entregados en custodia por reporte	64,694	149,164	Acciones emitidas	3,200,028,183	3,200,028,183
Valores prestados	223,649	405,335	Acciones en circulación, posición propia	8,988,961	12,050,710
Garantías recibidas por Valores Prestados	236,638	433,505	Acciones de Siefores, posición de terceros	1,127	1,127
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	60,513	58,865	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	1,176,268,069	1,256,562,948
Bancos divisas en moneda extranjera	7,555	4,547			
Dólares americanos	433	2,061			
Euros	231	2,157			
Yenes	6,891	329			
Divisas por recibir		1,546			
Dólares americanos		1,546			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	30,048,789	44,933,437			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	170,456	223,184			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	1,432,851	2,054,103			
Contratos Adelantados sobre Euros	42,141	134,792			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	38,255				
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional		496			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano		9,500			
Contratos de Opciones sobre renta variable Nacional	65				
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	10,843,657	14,058,806			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	1,889,628	5,163,994			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	1,108,474	1,108,474			
Contratos de Swaps sobre Tasa fija en Euros	173,098				
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	12,344,986	16,049,954			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	1,716,254	5,912,485			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	288,924	217,649			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	29,464,245	45,336,746			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	35,716	8,718			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	948,574	2,229,075			
Contratos Adelantados sobre Euros	20,532	179,113			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	38,352	49,782			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	13,725				
Contratos Futuros sobre Renta Variable Extranjera		77,020			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	42,356	285,918			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	11,149,358	14,863,376			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	1,791,530	5,753,629			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	1,395,053	1,577,087			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	387,298	305,265			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	11,407,048	14,719,038			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	2,061,605	5,288,725			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	173,098				

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$	804,317	\$	1,078,431
Un valor de los activos netos de:	\$	10,656,936	\$	10,813,676
El precio de la acción de:	\$	8.991236	\$	8.524003

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 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 JUNIO DE 2018 Y 2017

(Cifras en miles de pesos)

	2018	2017
Ingresos por la venta de Valores	1,778,579	3,256,379
Intereses, dividendos, premios y derechos	291,932	307,114
Resultado cambiario / Otros productos	3,534	(21,493)
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	97,702	57,261
INGRESOS NETOS	2,171,747	3,599,261
Costo de ventas de valores	1,714,571	3,012,003
Gastos generales	3,706	2,442
Comisiones sobre saldos	57,310	60,555
Intereses sobre inversiones en valores a entregar	6,507	12,568
EGRESOS NETOS	1,782,094	3,087,568
UTILIDAD DE OPERACIÓN	389,653	511,693
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(75,336)	(35,765)
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	314,317	475,928

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 23 de mayo de 2018, fueron aprobados los Estados Financieros al 31 de Marzo de 2018, asimismo, los presentes Estados Financieros al 30 de junio de 2018 serán aprobados en la Sesión del Consejo de Administración que se llevará a cabo el próximo 30 de agosto de 2018.