

**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 2018 Y 2017**

(Cifras en miles de pesos)

<b>ACTIVO</b>	<b>2018</b>	<b>2017</b>	<b>PASIVO</b>	<b>2018</b>	<b>2017</b>
<b>DISPONIBLE</b>			<b>OBLIGACIONES</b>		
Bancos moneda nacional	10	10	Divisas por entregar		96,824
Bancos monedas extranjeras	15,481	114,226	Acreedores	17	
Divisas por recibir		23,266	Provisiones para gastos	888	925
	<b>15,491</b>	<b>137,502</b>	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	935,291	852,386
			<b>TOTAL PASIVO</b>	<b>936,196</b>	<b>950,135</b>
<b>INVERSIONES</b>			<b>CAPITAL CONTABLE</b>		
Inversión en valores de renta variable	595,657	376,767		<b>2018</b>	<b>2017</b>
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	64,651	46,181	<b>CAPITAL</b>		
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	5,619,011	5,409,973	<b>CAPITAL CONTRIBUIDO</b>	<b>(1,025,372)</b>	<b>40,871</b>
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	796,662	894,436	Capital social pagado	3,964,179	4,330,394
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	2,079,895	1,821,889	Prima en venta de acciones	(4,989,551)	(4,289,523)
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(75,946)	(16,173)	<b>CAPITAL GANADO</b>	<b>10,359,948</b>	<b>9,525,865</b>
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	436,664	321,907	Resultados de ejercicios anteriores	9,871,107	8,768,821
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	60,520	72,327	Resultados del ejercicio	488,841	757,044
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	354,910	125,878	<b>OTROS RESULTADOS INTEGRALES</b>		
Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	9,677	7,508	PLUS (MINUS) VALÍAS	880,519	1,053,377
Inversión en FIBRAS	2,759	2,759	<b>TOTAL CAPITAL CONTABLE</b>	<b>10,215,095</b>	<b>10,620,113</b>
Plus (Minus) valía en Inversion en FIBRAS	(54)				
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	1,293	6,509			
Inversión en valores extranjeros de deuda	164,120	318,035			
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	23,671	45,317			
Inversión en instrumentos de deuda por reporto	49,134	180,671			
Plus (Minus) valía de valores por reporto	115	402			
Valores prestados	137,441	475,514			
Plus (Minus) valía de valores prestados	1,338	3,781			
	<b>10,321,518</b>	<b>10,093,681</b>			
<b>DEUDORES DIVERSOS</b>					
Liquidadora	814	157,789			
Dividendos o derechos por cobrar	77	17			
Intereses devengados sobre valores	112,427	116,462			
Reportos	(115)	(403)			
Premios por cobrar por prestamo de valores	5	20			
Intereses devengados por instrumentos recibidos en reporto	192	390			
Intereses devengados sobre valores prestados	2,556	7,898			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	698,326	1,056,892			
	<b>814,282</b>	<b>1,339,065</b>			
<b>TOTAL ACTIVO</b>	<b>11,151,291</b>	<b>11,570,248</b>	<b>TOTAL PASIVO MAS CAPITAL</b>	<b>11,151,291</b>	<b>11,570,248</b>



CUENTAS DE ORDEN	2018	2017	CUENTAS DE ORDEN	2018	2017
Valores entregados en custodia	9,993,796	9,426,804	Capital social autorizado	11,354,689	11,354,689
Valores entregados en custodia por reporte	49,326	181,060	Acciones emitidas	3,200,028,183	3,200,028,183
Valores prestados	138,779	479,295	Acciones en circulación, posición propia	8,218,996	12,050,709
Garantías recibidas por valores prestados	149,767	518,379	Acciones de Siefores, posición de terceros	1,127	1,127
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	63,161	129,558	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	1,108,982,378	1,208,358,836
Bancos divisas en moneda extranjera	1,173	6,589			
Dólares americanos	328	6,105			
Euros	426	155			
Yenes	419	329			
Divisas por recibir		1,281			
Dólares americanos		1,281			
Divisas por entregar		5,332			
Dólares americanos		5,332			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	27,986,799	43,205,710			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	162,332	222,086			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	1,524,613	1,779,691			
Contratos Adelantados sobre Euros	99,991				
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	38,255				
Contratos de Futuros sobre Renta Variable Nacional		5,569			
Contratos de Opciones sobre Renta Variable Nacional	65	69			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	9,410,756	13,488,391			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	2,300,733	5,432,487			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	1,085,336	1,108,474			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	173,098				
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	11,118,805	14,996,994			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	1,783,891	5,954,300			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	288,924	217,649			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	27,253,743	43,363,205			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	96,507				
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	845,929	1,791,786			
Contratos Adelantados sobre Euros	20,532	52,294			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	38,352	48,901			
Contratos de Futuros sobre Renta Variable Nacional	48,883				
Contratos de Futuros sobre Dólar Americano	42,356	276,171			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	9,923,177	13,810,417			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	2,011,354	5,795,443			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	1,242,749	1,577,087			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	363,949	305,265			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	9,974,148	14,148,623			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	2,472,709	5,557,218			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	173,098				

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$ 880,519	\$ 1,053,377
Un valor de los activos netos de:	\$ 10,215,095	\$ 10,620,113
El precio de la acción de:	\$ 9.143459	\$ 8.702081

---

**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 SEPTIEMBRE DE 2018 Y 2017

(Cifras en miles de pesos)

	2018	2017
Ingresos por la venta de Valores	2,882,104	4,350,017
Intereses, dividendos, premios y derechos	420,112	437,533
Resultado cambiario / Otros productos	(11,293)	(25,783)
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	118,366	65,585
<b>INGRESOS NETOS</b>	<b>3,409,289</b>	<b>4,827,352</b>
Costo de ventas de valores	2,820,605	3,964,283
Gastos generales	6,323	4,068
Comisiones sobre saldos	83,858	88,019
Intereses sobre inversiones en valores a entregar	9,662	13,938
<b>EGRESOS NETOS</b>	<b>2,920,448</b>	<b>4,070,308</b>
<b>UTILIDAD DE OPERACIÓN</b>	<b>488,841</b>	<b>757,044</b>
<b>OTROS RESULTADOS INTEGRALES</b>		
PLUS (MINUS) VALÍAS	866	(60,818)
<b>UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO</b>	<b>489,707</b>	<b>696,226</b>

**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.

#### NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS:

En la Sesión del Consejo de Administración con fecha 30 de agosto de 2018, fueron aprobados los Estados Financieros al 30 de junio de 2018, asimismo, los presentes Estados Financieros al 30 de septiembre de 2018 serán aprobados en la Sesión del Consejo de Administración que se llevará a cabo el próximo 29 de noviembre de 2018.