

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

**SIEFORE SURA BÁSICA 4, 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 2018 Y 2017

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2018	2017	PASIVO	2018	2017
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	10	10	Acreedores	128,900	323,459
Bancos monedas extranjeras	509,359	522,563	Provisiones para gastos	11,172	15,499
Divisas por recibir	2,557		Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	6,891,307	7,085,002
	511,926	522,573	TOTAL PASIVO	7,031,379	7,423,960
INVERSIONES					
Inversión en valores de renta variable	19,440,085	11,642,028			
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	(781,273)	2,358,747			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	38,803,328	34,303,713			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	1,847,914	1,819,608			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	27,243,762	32,010,268			
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(1,950,100)	(1,704,142)			
Inversiones tercerizadas	3,064,120	2,147,455			
Plus (Minus) valía en Inversiones tercerizadas	215,421	483,881			
Depósito Traspaso Banxico	2,929				
Plus (Minus) valía en inversión en el Depósito Traspaso Banxico	1				
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	5,501,777	6,967,898			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	67,386	1,035,665			
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	3,853,633	1,845,585			
Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	(51,139)	66,217			
Inversión en FIBRAS	3,670,949	3,508,940			
Plus (Minus) valía en Inversion en FIBRAS	(1,066,158)	(462,455)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	13,709	514,284			
Inversión en valores extranjeros de deuda	223,717	362,884			
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	6,611	35,124			
Inversión en títulos Fiduciarios	6,081,787	4,439,866			
Plus (minus) valía en Títulos Fiduciarios	1,047,690	935,430			
Inversión en instrumentos de deuda por reporto	1,479,265	4,048,375			
Plus (Minus) valía de valores por reporto	2,460	4,625			
Valores Prestados	3,465,968	648,619			
Plus (Minus) valía de valores prestados	23,160	(19,354)			
	112,207,002	106,993,261			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	120,807	130,138			
Dividendos o derechos por cobrar	536	62,364			
Intereses devengados sobre valores	609,326	642,105			
Reportos	(2,471)	(4,661)			
Premios por cobrar por préstamo de valores	151	30			
Intereses devengados por instrumentos recibidos en reporto	4,487	14,841			
Intereses devengados sobre valores prestados	26,442	2,635			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	4,607,419	6,346,773			
	5,366,697	7,194,225			
TOTAL ACTIVO	118,085,625	114,710,059			
			CAPITAL CONTABLE		
			CAPITAL		
			CAPITAL CONTRIBUIDO	63,615,248	58,656,907
			Capital social pagado	52,727,045	50,446,123
			Prima en venta de acciones	10,888,203	8,210,784
			CAPITAL GANADO	48,079,484	44,080,471
			Resultados de ejercicios anteriores	44,080,471	35,543,512
			Resultados del ejercicio	3,999,013	8,536,959
			OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
			PLUS (MINUS) VALÍAS	(640,486)	4,548,721
			TOTAL CAPITAL CONTABLE	111,054,246	107,286,099
			TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	118,085,625	114,710,059

CUENTAS DE ORDEN

Valores entregados en custodia	106,654,640	101,796,713	Capital social autorizado	126,259,200	126,259,200
Valores entregados en custodia por reporto	1,483,741	4,063,179	Acciones emitidas	25,000,019,801	25,000,019,801
Valores prestados	3,489,129	629,265	Acciones en circulación, posición propia	78,565,268	73,680,993
Garantías recibidas por valores prestados	3,668,251	663,041	Acciones de Siefores, posición de terceros	2	2
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	328,995	678,413	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	10,361,681,098	9,914,930,336
Bancos divisas en moneda extranjera	38,345	93,026			
Dólares americanos	25,457	24,773			
Euros	304	1,004			
Yenes	12,584	67,249			
Divisas por recibir	130				
Dólares americanos	130				
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	6,167,943	2,905,132			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	247,626,678	302,827,710			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	11,603,602	14,590,913			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	13,643,054	20,729,755			
Contratos Adelantados sobre Euros	3,674,737	1,999,811			
Contratos de Futuros sobre Renta Fija (Tasas)		2,887,366			
Contratos de Futuros sobre Renta Variable Nacional	1,319,451				
Contratos de Futuros sobre Renta Variable Extranjera	161,806	108,423			
Contratos de Opciones sobre Renta Variable Nacional	2,003	2,894			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	83,426,358	99,446,619			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	24,445,163	22,827,221			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	4,425,181	6,264,419			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	1,282,303				
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	79,917,415	100,334,181			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	21,873,839	31,577,288			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	1,851,766	2,058,820			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	235,797,585	285,086,245			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	1,339,038	109,281			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	15,522,187	9,665,523			
Contratos Adelantados sobre Euros	1,653,699	3,473,870			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas		1,106,637			
Contratos de Futuros sobre Renta Variable Nacional		193,440			
Contratos de Futuros sobre Dólar Americano		7,971,789			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	76,388,535	95,285,243			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	24,525,893	31,787,499			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	5,085,827	9,226,727			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	2,509,034	2,908,614			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	82,221,575	98,984,528			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	25,269,494	24,373,094			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	1,282,303				

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	-\$ 640,486	\$ 4,548,721
Un valor de los activos netos de:	\$ 111,054,246	\$ 107,286,099
El precio de la acción de:	\$ 10.637129	\$ 10.740842

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 4, 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 2018 Y 2017

(Cifras en miles de pesos)

	2018	2017
Ingresos por la venta de Valores	29,206,098	52,132,808
Intereses, dividendos, premios y derechos	6,623,757	5,891,795
Resultado cambiario / Otros productos	(181,719)	(510,324)
Resultados por Intermediación con Instrumentos Financieros Derivados	(543,690)	3,330,421
INGRESOS NETOS	35,104,446	60,844,700
Costo de ventas de valores	29,422,233	50,807,723
Gastos generales	129,199	73,608
Comisiones sobre saldos	1,188,088	1,102,760
Comisiones por servicios de tercerización	18,564	9,447
Intereses sobre inversiones en valores a entregar	347,349	314,203
EGRESOS NETOS	31,105,433	52,307,741
UTILIDAD DE OPERACIÓN	3,999,013	8,536,959
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(5,189,207)	1,703,823
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	(1,190,194)	10,240,782

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 29 de Noviembre de 2018, fueron aprobados los Estados Financieros al 30 de Septiembre de 2018, asimismo, los presentes Estados Financieros al 31 Diciembre de 2018 fueron aprobados en la Sesión del Consejo de Administración con fecha 13 de Febrero de 2019.