

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 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	Divisas por entregar	72,553	286,190
Bancos monedas extranjeras	72,254	470,223	Acreedores	472,694	469,518
Divisas por recibir		263,333	Provisiones para gastos	15,083	12,826
	72,264	733,566	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	6,873,081	6,909,581
INVERSIONES			TOTAL PASIVO	7,433,411	7,678,115
Inversión en valores de renta variable	18,071,003	14,511,067			
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	1,670,186	1,603,079			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	42,732,550	31,624,663			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	1,696,501	2,025,659			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	25,599,242	34,074,460			
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(1,232,245)	(450,475)			
Inversiones tercerizadas	3,064,120	2,147,455			
Plus (Minus) valía en Inversiones tercerizadas	508,480	2,906			
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	6,719,566	7,414,626			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	456,195	344,402			
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	1,873,132	1,694,995			
Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	63,107	51,191			
Inversión en FIBRAS	3,914,223	3,201,607			
Plus (Minus) valía en Inversion en FIBRAS	(569,278)	(104,021)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	69,034	402,588			
Inversión en valores extranjeros de deuda	245,073	2,105,262			
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	13,735	(118,850)			
Inversión en títulos Fiduciarios	5,363,278	4,003,895			
Plus (minus) valía en Títulos Fiduciarios	1,198,771	904,720			
Inversión en instrumentos de deuda por reporto	8,140,445	2,526,098			
Plus (Minus) valía de valores por reporto	3,266	3,234			
Valores Prestados	2,038,135	1,662,482			
Plus (Minus) valía de valores prestados	(67,016)	59,969			
	121,571,503	109,691,012			
DEUDORES DIVERSOS			CAPITAL CONTABLE	2018	2017
Liquidadora	584,505	79,624			
Dividendos o derechos por cobrar	61,720	328			
Intereses devengados sobre valores	637,058	517,441			
Reportos	(2,398)	(3,227)			
Premios por cobrar por préstamo de valores	94	43			
Intereses devengados por instrumentos recibidos en reporto	17,610	5,461			
Intereses devengados sobre valores prestados	10,156	21,587			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	5,466,291	7,073,942			
	6,775,036	7,695,199			
TOTAL ACTIVO	128,418,803	118,119,777	CAPITAL		
			CAPITAL CONTRIBUIDO	69,546,010	64,851,588
			Capital social pagado	55,530,154	53,601,351
			Prima en venta de acciones	14,015,856	11,250,237
				47,700,945	41,271,494
			CAPITAL GANADO	44,080,472	35,543,512
			Resultados de ejercicios anteriores	3,620,473	5,727,982
			Resultados del ejercicio		
			OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
			PLUS (MINUS) VALÍAS	3,738,437	4,318,580
			TOTAL CAPITAL CONTABLE	120,985,392	110,441,662
			TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	128,418,803	118,119,777

CUENTAS DE ORDEN	2017	2017	CUENTAS DE ORDEN	2018	2017
Valores entregados en custodia	111,205,840	105,036,641	Capital social autorizado	126,259,200	126,259,200
Valores entregados en custodia por reporte	8,158,923	2,531,566	Acciones emitidas	25,000,019,801	25,000,019,801
Valores prestados	1,971,119	1,722,451	Acciones en circulación, posición propia	81,276,191	77,979,480
Garantías recibidas por Valores Prestados	2,090,642	1,838,868	Acciones de Siefores, posición de terceros	2	2
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	512,365	833,122	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	10,914,001,371	10,535,384,370
Bancos divisas en moneda extranjera	100,811	526,346			
Dólares americanos	1,170	4,040			
Euros	1,381	15,315			
Yenes	98,260	506,991			
Divisas por recibir		14,507			
Dólares americanos		14,000			
Euros		507			
Divisas por entregar	3,685	15,844			
Dólares americanos	3,685	15,844			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	2,931,750	2,625,586			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	270,513,248	333,268,567			
Contratos Adelantados sobre Renta Fija (Bonos)	52,293				
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	15,138,325	10,201,800			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	15,264,925	20,371,961			
Contratos Adelantados sobre Euros	1,219,962	1,139,445			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	610,410				
Contratos Futuros sobre Renta Fija (Bonos)	53,187				
Contratos Futuros sobre Renta Fija (Tasas)	347,441	13,165,562			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	1,953,701	434,803			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Extranjera	259,308	93,674			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano		342,000			
Contratos de Opciones sobre renta variable Nacional	2,894				
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	92,334,690	102,375,393			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	16,295,074	30,954,759			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	6,358,439	6,264,419			
Contratos de Swaps sobre Tasa fija en Euros	1,282,303				
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	96,380,805	104,561,528			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	21,107,725	41,138,681			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	1,851,766	2,224,542			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	255,337,510	324,411,928			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	1,372,348				
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	16,528,737	23,068,218			
Contratos Adelantados sobre Euros	677,668	4,638,844			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	614,212	880,469			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	475,941	8,298,203			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	90,936,354	99,512,591			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	21,800,900	40,490,906			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	8,733,073	9,226,727			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	2,848,632	3,111,797			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	91,690,254	102,683,541			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	18,377,088	32,500,632			
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:	\$	3,738,437	\$	4,318,580
Un valor de los activos netos de:	\$	120,985,392	\$	110,441,662
El precio de la acción de:	\$	11.003396	\$	10.405906

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 30 DE JUNIO DE 2018 Y 2017

(Cifras en miles de pesos)

	2018	2017
Ingresos por la venta de Valores	15,873,765	25,598,425
Intereses, dividendos, premios y derechos	3,374,684	2,799,876
Resultado cambiario / Otros productos	(16,487)	(140,876)
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	1,009,205	2,948,861
INGRESOS NETOS	20,241,167	31,206,286
Costo de ventas de valores	15,756,534	24,688,216
Gastos generales	46,280	35,127
Comisiones sobre saldos	575,512	528,228
Comisiones por servicios de tercerización	9,016	3,445
Intereses sobre inversiones en valores a entregar	233,352	223,288
EGRESOS NETOS	16,620,694	25,478,304
UTILIDAD DE OPERACIÓN	3,620,473	5,727,982
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(810,284)	1,473,681
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	2,810,189	7,201,663

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.