

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 SEPTIEMBRE 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		186,775
Bancos monedas extranjeras	85,157	441,992	Acreedores	2,354	268,914
	85,167	442,002	Provisiones para gastos	15,599	15,010
			Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	6,670,723	5,337,647
INVERSIONES			TOTAL PASIVO	6,688,676	5,808,346
Inversión en valores de renta variable	20,136,590	13,929,996			
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	1,346,085	2,107,122			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	46,150,746	35,485,914			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	2,516,787	2,422,185			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	28,262,260	32,246,532			
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(1,302,076)	(515,418)			
Inversiones tercerizadas	3,064,120	2,147,455			
Plus (Minus) valía en Inversiones tercerizadas	504,615	119,765			
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	6,768,781	8,222,743			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	30,903	510,971			
Instrumentos otorgados en garantía por Operaciones Derivadas	2,226,193	1,255,518			
Plus Minus valía en Instrumentos otorgados en garantía por Operaciones Derivadas	79,410	50,893			
Inversión en FIBRAS	3,922,081	3,387,970			
Plus (Minus) valía en Inversion en FIBRAS	(767,272)	(296,442)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	9,373	410,680			
Inversión en valores extranjeros de deuda	245,072	2,105,262			
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	13,276	(111,589)			
Inversión en títulos Fiduciarios	6,159,139	4,187,397			
Plus (minus) valía en Títulos Fiduciarios	1,268,071	925,341			
Inversión en instrumentos de deuda por reporto	3,170,743	4,364,003			
Plus (Minus) valía de valores por reporto	7,630	4,497			
Valores Prestados	2,656,671	1,319,719			
Plus (Minus) valía de valores prestados	24,758	73,819			
	126,493,956	114,354,333			
DEUDORES DIVERSOS			CAPITAL CONTABLE	2018	2017
Liquidadora	589,460	352,831			
Dividendos o derechos por cobrar	50,205	51,223			
Intereses devengados sobre valores	1,179,010	1,158,118			
Reportos	(7,638)	(3,896)			
Premios por cobrar por préstamo de valores	147	30			
Intereses devengados por instrumentos recibidos en reporto	12,877	10,780			
Intereses devengados sobre valores prestados	46,291	9,850			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	5,782,509	6,620,559			
	7,652,861	8,199,495	CAPITAL		
			CAPITAL CONTRIBUIDO	74,015,285	68,645,748
			Capital social pagado	57,560,137	55,418,392
			Prima en venta de acciones	16,455,148	13,227,356
			CAPITAL GANADO	49,813,467	43,255,088
			Resultados de ejercicios anteriores	44,080,472	35,543,512
			Resultados del ejercicio	5,732,995	7,711,576
			OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
			PLUS (MINUS) VALÍAS	3,714,556	5,286,648
			TOTAL CAPITAL CONTABLE	127,543,308	117,187,484

TOTAL ACTIVO	134,231,984	122,995,830

TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	134,231,984	122,995,830

CUENTAS DE ORDEN	2018	2017	CUENTAS DE ORDEN	2018	2017
Valores entregados en custodia	120,410,982	108,181,616	Capital social autorizado	126,259,200	126,259,200
Valores entregados en custodia por reporte	3,183,611	4,375,385	Acciones emitidas	25,000,019,801	25,000,019,801
Valores prestados	2,681,428	1,393,537	Acciones en circulación, posición propia	85,716,879	80,535,118
Garantías recibidas por valores prestados	2,872,822	1,484,299	Acciones de Siefores, posición de terceros	2	2
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	790,881	1,003,682	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	11,311,508,583	10,892,613,026
Bancos divisas en moneda extranjera	102,703	334,328			
Dólares americanos	2,998	18,551			
Euros	584	2,543			
Yenes	99,121	313,234			
Divisas por entregar		10,286			
Dólares americanos		10,286			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	5,877,930	2,823,751			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	270,399,494	337,198,647			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	14,172,432	13,149,374			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	20,801,663	23,252,109			
Contratos Adelantados sobre Euros	2,200,017	466,470			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	610,410				
Contratos de Futuros sobre Renta Fija (Tasas)		6,660,996			
Contratos de Futuros sobre Renta Variable Nacional	1,404,005	650,025			
Contratos de Futuros sobre Renta Variable Extranjera	174,397	96,082			
Contratos de Opciones sobre Renta Variable Nacional	2,894	3,252			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	86,982,143	100,507,319			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	22,757,859	37,378,397			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	6,044,711	6,264,419			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	1,282,303				
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	89,954,735	102,696,318			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	22,160,159	43,849,344			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	1,851,766	2,224,542			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	254,999,379	324,817,066			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	3,019,227				
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	18,849,037	19,232,202			
Contratos Adelantados sobre Euros	934,863	3,846,935			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	614,212	859,904			
Contratos de Futuros sobre Dólar Americano	475,941	7,949,055			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	84,510,285	97,647,381			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	24,731,452	44,035,568			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	7,308,600	9,226,727			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	2,537,132	3,111,797			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	85,896,454	99,983,227			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	24,839,873	38,924,270			
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:	\$ 3,714,556	\$ 5,286,648
Un valor de los activos netos de:	\$ 127,543,308	\$ 117,187,484
El precio de la acción de:	\$ 11.190733	\$ 10.679477

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 SEPTIEMBRE DE 2018 Y 2017

(Cifras en miles de pesos)

	2018	2017
Ingresos por la venta de Valores	23,598,074	39,432,788
Intereses, dividendos, premios y derechos	4,967,524	4,183,022
Resultado cambiario / Otros productos	(129,217)	(579,342)
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	2,221,875	3,914,418
INGRESOS NETOS	30,658,256	46,950,886
Costo de ventas de valores	23,625,254	38,089,376
Gastos generales	75,935	55,252
Comisiones sobre saldos	890,464	818,796
Comisiones por servicios de tercerización	13,728	6,265
Intereses sobre inversiones en valores a entregar	319,880	269,621
EGRESOS NETOS	24,925,261	39,239,310
UTILIDAD DE OPERACIÓN	5,732,995	7,711,576
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(834,165)	2,441,748
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	4,898,830	10,153,324

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.