

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 2017 Y 2016

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2017	2016	PASIVO	2017	2016
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	10	11	Divisas por entregar	96,824	26,825
Bancos monedas extranjeras	114,226	309,039	Acreedores		166,834
Divisas por recibir	23,266	161,803	Provisiones para gastos	925	1,278
	137,502	470,853	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	852,386	1,283,911
			TOTAL PASIVO	950,135	1,478,848
INVERSIONES			CAPITAL CONTABLE		
Inversión en valores de renta variable	376,767	292,752		2017	2016
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	46,181	202,893	CAPITAL		
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	5,409,973	6,682,325	CAPITAL CONTRIBUIDO	40,871	4,272,095
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	894,436	956,767	Capital social pagado	4,330,394	6,154,283
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	1,821,889	4,150,170	Prima en venta de acciones	(4,289,523)	(1,882,188)
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(16,173)	80,568	CAPITAL GANADO	9,525,865	8,706,250
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	321,907	557,185	Resultados de ejercicios anteriores	8,768,821	8,386,593
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	72,327	185,085	Resultados del ejercicio	757,044	319,657
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	125,878	-	OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	7,508	-	PLUS (MINUS) VALÍAS	1,053,377	1,471,273
Inversión en FIBRAS	2,759		TOTAL CAPITAL CONTABLE	10,620,113	14,449,618
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	6,509	31,262			
Inversión en valores extranjeros de deuda	318,035	322,642			
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	45,317	45,960			
Inversión en instrumentos de deuda por reporto	180,671	609,210			
Plus (Minus) valía de valores por reporto	402	1,026			
Valores prestados	475,514	-			
Plus (Minus) valía de valores prestados	3,781	-			
	10,093,681	14,117,845			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	157,789	27,338			
Dividendos o derechos por cobrar	17	549			
Intereses devengados sobre valores	116,462	181,328			
Reportos	(403)	(1,004)			
Premios por cobrar por prestamo de valores	20	-			
Intereses devengados por instrumentos recibidos en reporto	390	294			
Intereses devengados sobre valores prestados	7,898	-			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	1,056,892	1,131,263			
	1,339,065	1,339,768			
TOTAL ACTIVO	11,570,248	15,928,466	TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	11,570,248	15,928,466

CUENTAS DE ORDEN	2017	2016	CUENTAS DE ORDEN	2017	2016
Valores entregados en custodia	9,426,804	13,476,347	Capital social autorizado	11,354,689	11,354,689
Valores entregados en custodia por reporte	181,060	609,526	Acciones emitidas	3,200,028,183	3,200,028,183
Valores prestados	479,295	-	Acciones en circulación, posición propia	12,050,709	15,053,855
Garantías recibidas por valores prestados	518,379	-	Acciones de Siefores, posición de terceros	1,127	1,127
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	129,558	16,340	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	1,208,358,836	1,719,372,143
Bancos divisas en moneda extranjera	6,589	15,762			
Dólares americanos	6,105	9,883			
Euros	155	5,393			
Yenes	329	486			
Divisas por recibir	1,281	8,350			
Dólares americanos	1,281	8,350			
Divisas por entregar	5,332	1,384			
Dólares americanos	5,332	1,384			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	43,205,710	39,382,992	-		
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	222,086	28,655			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	1,779,691	825,728			
Contratos Adelantados sobre Euros		37,019			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas		103,014			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	5,569	9,734			
Contratos Opcionales sobre Renta Variable Nacional	69				
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	13,488,391	12,511,965			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	5,432,487	4,600,989			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	1,108,474	1,379,564			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	14,996,994	14,574,271			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	5,954,300	5,312,053			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	217,649				
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	43,363,205	40,712,623			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera		21,495			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	1,791,786	2,026,467			
Contratos Adelantados sobre Euros	52,294	-			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	48,901	129,502			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Extranjera		28,148			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	276,171	132,539			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	13,810,417	12,941,337			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	5,795,443	5,123,065			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	1,577,087	1,964,850			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	305,265	145,980			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	14,148,623	13,473,520			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	5,557,218	4,725,720			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$ 1,053,377	\$ 1,471,273
Un valor de los activos netos de:	\$ 10,620,113	\$ 14,449,618
El precio de la acción de:	\$ 8.702081	\$ 8.331061

GABRIEL VILLAGÓMEZ GÓMEZ
Contador General de SIEFORE

ENRIQUE SOLÓRZANO PALACIO
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 2017 Y 2016

(Cifras en miles de pesos)

	2017	2016
Ingresos por la venta de Valores	4,350,017	2,146,435
Intereses, dividendos, premios y derechos	437,533	559,165
Resultado cambiario / Otros productos	(25,783)	1,649
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	65,585	(261,893)
INGRESOS NETOS	4,827,352	2,445,356
Costo de ventas de valores	3,964,283	1,984,086
Gastos generales	4,068	894
Comisiones sobre saldos	88,019	114,332
Intereses sobre inversiones en valores a entregar	13,938	26,387
EGRESOS NETOS	4,070,308	2,125,699
UTILIDAD DE OPERACIÓN	757,044	319,657
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(60,818)	391,662
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	696,226	711,319

GABRIEL VILLAGÓMEZ GÓMEZ
Contador General de SIEFORE

ENRIQUE SOLÓRZANO PALACIO
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 28 de agosto de 2017, fueron aprobados los Estados Financieros al 30 de junio de 2017, asimismo, los presentes Estados Financieros al 30 de septiembre de 2017 y 2016 serán aprobados en la Sesión del Consejo de Administración que se llevará a cabo el próximo 7 de noviembre de 2017.