

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 31 DE DICIEMBRE DE 2018 Y 2017

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2018	2017	PASIVO	2018	2017
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	10	11	Acreedores	79,882	143,903
Bancos monedas extranjeras	69,769	32,013	Provisiones para gastos	736	1,405
Divisas por recibir	1,301		Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	971,676	1,084,905
	71,080	32,024	TOTAL PASIVO	1,052,294	1,230,213
INVERSIONES			CAPITAL CONTABLE		
Inversión en valores de renta variable	825,456	440,192	CAPITAL		
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	(13,416)	100,247	CAPITAL CONTRIBUIDO	1,525,546	1,389,054
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	6,518,702	5,523,935	Capital social pagado	4,988,425	4,927,905
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	809,651	742,037	Prima en venta de acciones	(3,462,879)	(3,538,851)
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	2,770,280	3,426,318			
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(187,492)	(148,955)	CAPITAL GANADO	10,569,101	9,871,107
Depósito Traspaso Banxico	2,891		Resultados de ejercicios anteriores	9,871,107	8,768,821
Plus (Minus) valía en inversión en el Depósito Traspaso Banxico	1		Resultados del ejercicio	697,994	1,102,286
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	644,639	533,507			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	73,966	144,282	OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	499,410	160,806	PLUS (MINUS) VALÍAS	702,566	879,652
Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	(6,319)	9,965			
Inversión en FIBRAS	2,759	2,759	TOTAL CAPITAL CONTABLE	12,797,213	12,139,813
Plus (Minus) valía en Inversion en FIBRAS	(109)	(28)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados		3,631			
Inversión en valores extranjeros de deuda	179,037	252,367			
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	20,724	46,207			
Inversión en instrumentos de deuda por reporto	20,355	800,726			
Plus (Minus) valía de valores por reporto	34	1,183			
Valores Prestados	755,927	223,736			
Plus (Minus) valía de valores prestados	5,562	(14,102)			
	12,922,058	12,248,813			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	78,005	27			
Dividendos o derechos por cobrar	26				
Intereses devengados sobre valores	84,532	91,721			
Reportos	(34)	(1,195)			
Premios por cobrar por préstamo de valores	40	9			
Intereses devengados por instrumentos recibidos en reporto	62	4,233			
Intereses devengados sobre valores prestados	4,364	881			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	689,374	993,513			
	856,369	1,089,189			
TOTAL ACTIVO	13,849,507	13,370,026	TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	13,849,507	13,370,026

CUENTAS DE ORDEN

Valores entregados en custodia	11,966,981	11,233,638	Capital social autorizado	11,354,689	11,354,689
Valores entregados en custodia por reporto	20,416	804,947	Acciones emitidas	3,200,028,183	3,200,028,183
Valores prestados	761,489	209,634	Acciones en circulación, posición propia	10,758,707	10,896,418
Garantías recibidas por valores prestados	796,170	221,779	Acciones de Siefores, posición de terceros	1,127	1,127
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	73,171	72,185	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	1,395,099,836	1,377,906,351
Bancos divisas en moneda extranjera	4,962	1,903			
Dólares americanos	3,306	1,316			
Euros	202	258			
Yenes	1,454	329			
Divisas por recibir	66	-			
Dólares americanos	66	-			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	27,292,520	38,197,888			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	127,395	166,974			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	1,348,673	1,410,337			
Contratos Adelantados sobre Euros	193,308	73,712			
Contratos de Opciones sobre Renta Variable Nacional	65	65			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	9,407,481	13,032,179			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	2,604,515	3,702,156			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	973,543	1,108,474			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	173,098				
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	10,411,425	13,929,394			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	1,764,093	4,485,673			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	288,924	288,924			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	26,798,643	37,710,576			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	37,422				
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	984,043	680,985			
Contratos Adelantados sobre Euros	104,225	117,232			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas		75,469			
Contratos de Futuros sobre Renta Variable Nacional	44,914	13,978			
Contratos de Futuros sobre Dólar Americano		276,454			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	9,347,187	12,742,817			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	2,058,006	4,411,226			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	1,093,805	1,577,088			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	376,092	387,298			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	9,905,486	13,601,142			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	2,674,365	3,826,887			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	173,098				

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$ 702,566	\$ 879,652
Un valor de los activos netos de:	\$ 12,797,213	\$ 12,139,813
El precio de la acción de:	\$ 9.102767	\$ 8.741200

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 31 DE DICIEMBRE DE 2018 Y 2017

(Cifras en miles de pesos)

	2018	2017
Ingresos por la venta de Valores	3,789,331	6,967,424
Intereses, dividendos, premios y derechos	588,743	600,851
Resultado cambiario / Otros productos	(13,077)	(21,444)
Resultados por Intermediación con Instrumentos Financieros Derivados	128,049	29,530
INGRESOS NETOS	4,493,046	7,576,361
Costo de ventas de valores	3,656,162	6,327,390
Gastos generales	11,497	5,553
Comisiones sobre saldos	115,163	118,415
Intereses sobre inversiones en valores a entregar	12,230	22,717
EGRESOS NETOS	3,795,052	6,474,075
UTILIDAD DE OPERACIÓN	697,994	1,102,286
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(177,086)	(234,543)
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	520,908	867,743

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.