

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 2017 Y 2016

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2017	2016	PASIVO	2017	2016
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	10	10	Divisas por entregar	186,775	704,538
Bancos monedas extranjeras	441,992	1,165,348	Acreedores	268,914	1,915,714
Divisas por recibir		1,495,128	Provisiones para gastos	15,010	9,575
	442,002	2,660,486	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	5,337,647	8,291,398
RESERVADOS					
Depósitos reservados al pago compromisos futuros en divisas		75,750			
	-	75,750			
INVERSIONES					
Inversión en valores de renta variable	13,929,996	14,632,990	TOTAL PASIVO	5,808,346	10,921,225
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	2,107,122	3,707,976			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	35,485,914	26,543,870			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	2,422,185	1,988,065			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	32,246,532	39,979,039			
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(515,418)	383,013			
Inversiones tercerizadas	2,147,455		CAPITAL CONTABLE	2017	2016
Plus (Minus) valía en Inversiones tercerizadas	119,765				
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	8,222,743	4,755,399			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	510,971	1,003,202	CAPITAL		
Instrumentos otorgados en garantía por Operaciones Derivadas	1,255,518	-			
Plus Minus valia en Instrumentos otorgados en garantía por Operaciones Derivadas	50,893	-	CAPITAL CONTRIBUIDO	68,645,748	64,792,438
Inversión en FIBRAS	3,387,970	2,971,575	Capital social pagado	55,418,392	53,744,555
Plus (Minus) valía en Inversion en FIBRAS	(296,442)	(19,575)	Prima en venta de acciones	13,227,356	11,047,883
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	410,680	1,025,870			
Inversión en valores extranjeros de deuda	2,105,262	601,293	CAPITAL GANADO	43,255,088	34,091,191
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	(111,589)	55,225	Resultados de ejercicios anteriores	35,543,512	33,408,562
Inversión en títulos Fiduciarios	4,187,397	3,822,249	Resultados del ejercicio	7,711,576	682,629
Plus (minus) valía en Títulos Fiduciarios	925,341	987,699			
Inversión en instrumentos de deuda por reporte	4,364,003	3,332,287	OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
Plus (Minus) valía de valores por reporte	4,497	2,730	PLUS (MINUS) VALÍAS	5,286,648	8,105,604
Valores Prestados	1,319,719	-			
Plus (Minus) valía de valores prestados	73,819	-	TOTAL CAPITAL CONTABLE	117,187,484	106,989,233
	114,354,333	105,772,907			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	352,831	504,932			
Dividendos o derechos por cobrar	51,223	5,341			
Intereses devengados sobre valores	1,158,118	1,196,928			
Reportos	(3,896)	(2,604)			
Premios por cobrar por préstamo de valores	30	-			
Intereses devengados por instrumentos recibidos en reporte	10,780	7,821			
Intereses devengados sobre valores prestados	9,850	-			

Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	6,620,559	7,688,897			
	8,199,495	9,401,315			
TOTAL ACTIVO	122,995,830	117,910,458	TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	122,995,830	117,910,458

CUENTAS DE ORDEN	2017	2016	CUENTAS DE ORDEN	2017	2016
Valores entregados en custodia	108,181,616	101,412,019	Capital social autorizado	126,259,200	126,259,200
Valores entregados en custodia por reporte	4,375,385	3,340,234	Acciones emitidas	25,000,019,801	25,000,019,801
Valores prestados	1,393,537	-	Acciones en circulación, posición propia	80,535,118	79,430,495
Garantías recibidas por valores prestados	1,484,299	-	Acciones de Siefres, posición de terceros	2	2
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	1,003,682	373,497	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	10,892,613,026	10,562,288,646
Bancos divisas en moneda extranjera	334,328	743,101			
Dólares americanos	18,551	31,452			
Euros	2,543	19,451			
Yenes	313,234	692,198			
Divisas por recibir	-	77,158			
Dólares americanos		77,158			
Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en moneda extranjera	-	3,909			
Dólares americanos		3,909			
Divisas por entregar	10,286	36,358			
Dólares americanos	10,286	36,358			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	2,823,751	2,656,478			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	337,198,647	298,806,885			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	13,149,374	5,688,839			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	23,252,109	11,144,679			
Contratos Adelantados sobre Euros	466,470	-			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas		1,148,710			
Contratos Futuros sobre Renta Fija (Tasas)	6,660,996	32,679,262			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	650,025	776,362			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Extranjera	96,082	1,474,280			
Contratos Opcionales sobre Renta Variable Nacional	3,252				
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	100,507,319	82,353,613			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	37,378,397	27,387,137			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	6,264,419	7,069,463			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	102,696,318	89,804,046			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	43,849,344	39,073,440			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	2,224,542	207,054			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	324,817,066	271,588,941			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	19,232,202	15,425,922			
Contratos Adelantados sobre Euros	3,846,935	1,725,115			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	859,904	1,757,247			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	7,949,055	7,019,905			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	97,647,381	83,574,129			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	44,035,568	37,175,042			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	9,226,727	10,392,242			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	3,111,797	763,249			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	99,983,227	84,823,080			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	38,924,270	28,933,010			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$ 5,286,648	\$ 8,105,604
Un valor de los activos netos de:	\$ 117,187,484	\$ 106,989,233
El precio de la acción de:	\$ 10.679477	\$ 10.053755

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 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 2017 Y 2016

(Cifras en miles de pesos)

	2017	2016
Ingresos por la venta de Valores	39,432,788	27,690,944
Intereses, dividendos, premios y derechos	4,183,022	3,752,941
Resultado cambiario / Otros productos	(579,342)	348,611
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	3,914,418	(4,029,385)
INGRESOS NETOS	46,950,886	27,763,111
Costo de ventas de valores	38,089,376	26,216,820
Gastos generales	55,252	17,831
Comisiones sobre saldos	818,796	754,174
Comisiones por servicios de tercerización	6,265	
Intereses sobre inversiones en valores a entregar	269,621	91,657
EGRESOS NETOS	39,239,310	27,080,482
UTILIDAD DE OPERACIÓN	7,711,576	682,629
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	2,441,748	3,673,631
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	10,153,324	4,356,260

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.