

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 MARZO DE 2016 Y 2015

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2016	2015	PASIVO	2016	2015
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	10	10	Provisiones para gastos	442	436
Bancos monedas extranjeras	130,014	172,553	Divisas por entregar	6,895	-
	130,024	172,563	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	1,361,568	1,157,256
INVERSIONES			TOTAL PASIVO	1,368,905	1,157,692
Inversión en valores de renta variable	374,718	379,917			
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	182,077	203,695			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	6,323,168	5,767,879			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	902,497	976,411			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	4,191,600	4,070,182			
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	113,805	212,203			
Depósito Traspaso Banxico	5,679	6,069			
Plus (Minus) valía en inversión en el Depósito Traspaso Banxico	66	31			
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	449,700	406,432	CAPITAL		
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	105,337	74,005	CAPITAL CONTRIBUIDO	4,614,731	4,507,476
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	18,301	58,751	Capital social pagado	6,306,332	6,253,114
Inversión en valores extranjeros de deuda	356,722	531,412	Prima en venta de acciones	(1,691,601)	(1,745,638)
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	48,818	64,139	CAPITAL GANADO	8,324,687	7,887,306
Inversión en instrumentos de deuda por reporto	1,113,189	921,744	Resultados de ejercicios anteriores	8,386,593	7,708,277
Plus (Minus) valía de valores por reporto	391	506	Resultados del ejercicio	(61,906)	179,029
	14,186,068	13,673,376	OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
DEUDORES DIVERSOS			PLUS (MINUS) VALÍAS	1,352,600	1,530,483
Liquidadora	73	28			
Dividendos o derechos por cobrar	1,077	874	TOTAL CAPITAL CONTABLE	14,292,018	13,925,265
Intereses devengados sobre valores	170,627	162,793			
Reportos	(390)	(536)			
Intereses devengados por instrumentos recibidos en reporto	7,430	7,157			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	1,166,014	1,066,702			
	1,344,831	1,237,018			
	-	-			
TOTAL ACTIVO	15,660,923	15,082,957	TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	15,660,923	15,082,957

CUENTAS DE ORDEN	2016	2015	CUENTAS DE ORDEN	2016	2015
Valores entregados en custodia	13,054,187	12,692,375	Capital social autorizado	11,354,689	11,354,689
Valores entregados en custodia por reporto	1,120,621	928,871	Acciones emitidas	3,200,028,183	3,200,028,183
Bancos divisas en moneda extranjera	28,657	17,251	Acciones en circulación, posición propia	15,053,855	15,050,092
Dólares americanos	4,984	10,872	Acciones de Siefores, posición de terceros	1,127	1,127
Euros	2,080	356	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	1,762,223,289	1,747,228,811
Yenes	21,593	6,023			
Divisas por entregar	400	-			
Dólares americanos	400	-			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	37,744,353	33,010,273			
Contratos Adelantados sobre Renta Fija (Bonos)	-	385,650			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	24,974	8,511			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	1,174,479	31,580			
Contratos Adelantados sobre Euros	147,352	1,674			
Contratos Adelantados sobre Yenes	-	6,626			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	9,326	9,172			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	11,290,927	10,342,525			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	4,103,685	3,132,693			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	1,354,690	1,216,297			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	14,617,103	13,460,357			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	5,021,817	4,415,188			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	37,861,863	33,699,016			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	52,261	19,840			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	805,182	-			
Contratos Adelantados sobre Euros	217,986	318,040			
Contratos Adelantados sobre Yenes	-	5,657			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	94,754	-			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Extranjera	9,293	-			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	295,298	789,087			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	12,960,647	11,858,059			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	4,789,929	4,178,263			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	1,933,493	1,879,079			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	204,344	204,344			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	12,220,800	11,142,870			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	4,277,876	3,303,777			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$	1,352,600	\$	1,530,483
Un valor de los activos netos de:	\$	14,292,018	\$	13,925,265
El precio de la acción de:	\$	8.041520	\$	7.901846

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 31 DE MARZO DE 2016 Y 2015

(Cifras en miles de pesos)

	2016	2015
Ingresos por la venta de Valores	501,383	699,328
Intereses, dividendos, premios y derechos	185,747	175,930
Resultado cambiario / Otros productos	(715)	48,623
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	(224,470)	(48,332)
INGRESOS NETOS	461,945	875,549
Costo de ventas de valores	473,938	652,498
Gastos generales	375	249
Comisiones sobre saldos	37,066	38,023
Intereses sobre inversiones en valores a entregar	12,472	5,750
EGRESOS NETOS	523,851	696,520
UTILIDAD DE OPERACIÓN	(61,906)	179,029
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	272,989	(155,516)
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	211,083	23,513

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.

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS:

En la Sesión del Consejo de Administración con fecha 4 de febrero de 2016, fueron aprobados los Estados Financieros al 31 de Diciembre de 2015 y 2014, así mismo, los presentes Estados Financieros al 31 de Marzo de 2016 y 2015 serán aprobados en la Sesión del Consejo de Administración que se llevará a cabo el próximo 3 de Junio de 2016.