

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

**SIFORE 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 2017 Y 2016

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2017	2016	PASIVO	2017	2016
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	232	10	Divisas por entregar	315,937	6,895
Bancos monedas extranjeras	291,996	130,014	Acreedores	160,032	-
Divisas por recibir	79,451	-	Provisiones para gastos	1,179	442
	371,679	130,024	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	1,211,506	1,361,568
INVERSIONES					
Inversión en valores de renta variable	337,206	374,718			
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	190,147	182,077			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	5,667,671	6,323,168			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	834,177	902,497			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	2,765,447	4,191,600			
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(69,011)	113,805			
Depósito Traspaso Banxico	-	5,679			
Plus (Minus) valía en inversión en el Depósito Traspaso Banxico	-	66			
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	473,661	449,700			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	97,480	105,337			
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	131,112	-			
Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	6,040	-			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	2,983	18,301			
Inversión en valores extranjeros de deuda	346,022	356,722			
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	40,220	48,818			
Inversión en instrumentos de deuda por reporto	228,421	1,113,189			
Plus (Minus) valía de valores por reporto	456	391			
Valores Prestados	107,608	-			
Plus (Minus) valía de valores prestados	(4,657)	-			
	11,154,983	14,186,068			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	386,056	73			
Dividendos o derechos por cobrar	489	1,077			
Intereses devengados sobre valores	139,087	170,627			
Reportos	(455)	(390)			
Premios por cobrar por préstamo de valores	3	-			
Intereses devengados por instrumentos recibidos en reporto	165	7,430			
Intereses devengados sobre valores prestados	1,835	-			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	1,208,382	1,166,014			
	1,735,562	1,344,831			
	-	-			
TOTAL ACTIVO	13,262,224	15,660,923			
			TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	13,262,224	15,660,923

CUENTAS DE ORDEN	2017	2016	CUENTAS DE ORDEN	2017	2016
Valores entregados en custodia	10,820,173	13,054,187	Capital social autorizado	11,354,689	11,354,689
Valores entregados en custodia por reporte	228,587	1,120,621	Acciones emitidas	3,200,028,183	3,200,028,183
Valores prestados	102,951	-	Acciones en circulación, posición propia	12,050,709	15,053,855
Garantías recibidas por préstamo de valores	111,196	-	Acciones de Siefores, posición de terceros	1,127	1,127
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	68	-	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	1,373,179,145	1,762,223,289
Bancos divisas en moneda extranjera	15,567	28,657			
Dólares americanos	13,130	4,984			
Euros	2,254	2,080			
Yenes	183	21,593			
Divisas por recibir	4,227	-			
Dólares americanos	4,227	-			
Divisas por entregar	16,809	400			
Dólares americanos	16,809	400			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	45,291,173	37,744,353			
Contratos Adelantados sobre Renta Fija (Bonos)	-	-			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	32,774	24,974			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	2,793,875	1,174,479			
Contratos Adelantados sobre Euros	43,470	147,352			
Contratos Adelantados sobre Yenes	-	-			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	5,208	9,326			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	14,074,646	11,290,927			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	4,958,687	4,103,685			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	1,379,564	1,354,690			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	16,090,464	14,617,103			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	5,912,485	5,021,817			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	45,811,610	37,861,863			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	9,253	52,261			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	2,779,005	805,182			
Contratos Adelantados sobre Euros	185,403	217,986			
Contratos Adelantados sobre Yenes	-	-			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	49,782	94,754			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Extranjera	77,986	9,293			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	259,560	295,298			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	14,496,137	12,960,647			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	5,740,564	4,789,929			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	2,023,853	1,933,493			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	87,616	204,344			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	15,019,033	12,220,800			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	5,083,418	4,277,876			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$ 1,094,397	\$ 1,352,600
Un valor de los activos netos de:	\$ 11,573,570	\$ 14,292,018
El precio de la acción de:	\$ 8.354975	\$ 8.041520

GABRIEL VILLAGÓMEZ GÓMEZ
Contador General de SIEFORE

ENRIQUE SOLÓRZANO PALACIO
Director General

Declaro bajo protesta de decir verdad que los datos contenidos son auténticos y veraces

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 2017 Y 2016

(Cifras en miles de pesos)

	2017	2016
Ingresos por la venta de Valores	2,211,966	501,383
Intereses, dividendos, premios y derechos	166,262	185,747
Resultado cambiario / Otros productos	(18,384)	(715)
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	64,122	(224,470)
INGRESOS NETOS	2,423,966	461,945
Costo de ventas de valores	2,107,765	473,938
Gastos generales	1,144	375
Comisiones sobre saldos	31,744	37,066
Intereses sobre inversiones en valores a entregar	10,042	12,472
EGRESOS NETOS	2,150,695	523,851
UTILIDAD DE OPERACIÓN	273,271	(61,906)
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(19,798)	272,989
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	253,473	211,083

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 febrero de 2017, fueron aprobados los Estados Financieros al 31 de Diciembre de 2016, asimismo, los presentes Estados Financieros al 31 de marzo de 2017 serán aprobados en la Sesión del Consejo de Administración que se llevará a cabo el próximo 23 de mayo de 2017.