

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 2018 Y 2017

(Cifras en miles de pesos)

| ACTIVO | 2018 | 2017 | PASIVO | 2018 | 2017 |
|---|-------------------|-------------------|---|-------------------|-------------------|
| DISPONIBLE | | | OBLIGACIONES | | |
| Bancos moneda nacional | 9 | 232 | Acreeedores | 5,428 | 160,032 |
| Bancos monedas extranjeras | 24,125 | 291,996 | Divisas por entregar | - | 315,937 |
| Divisas por recibir | 152 | 79,451 | Provisiones para gastos | 1,636 | 1,179 |
| | 24,286 | 371,679 | Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC) | 853,441 | 1,211,506 |
| INVERSIONES | - | - | | | |
| Inversión en valores de renta variable | 542,315 | 337,206 | TOTAL PASIVO | 860,505 | 1,688,654 |
| Plus (Minus) valía en valores de renta variable | 54,297 | 190,147 | | | |
| Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís | 5,721,258 | 5,667,671 | CAPITAL CONTABLE | 2018 | 2017 |
| Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís | 749,269 | 834,177 | CAPITAL | | |
| Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos | 2,879,781 | 2,765,447 | CAPITAL CONTRIBUIDO | 355,396 | 1,437,081 |
| Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos | (85,440) | (69,011) | Capital social pagado | 4,509,805 | 4,915,227 |
| Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso | 501,802 | 473,661 | Prima en venta de acciones | (4,154,409) | (3,478,146) |
| Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso | 78,531 | 97,480 | | | |
| Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas | 218,580 | 131,112 | CAPITAL GANADO | 10,028,582 | 9,042,092 |
| Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas | 9,701 | 6,040 | Resultados de ejercicios anteriores | 9,871,107 | 8,768,821 |
| Inversión en FIBRAS | 2,759 | | Resultados del ejercicio | 157,475 | 273,271 |
| Plus(Minus)valia en inversión de FIBRAS | (28) | | | | |
| Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados | 840 | 2,983 | OTROS RESULTADOS INTEGRALES | | |
| Inversión en valores extranjeros de deuda | 164,120 | 346,022 | PLUS (MINUS) VALÍAS | 831,167 | 1,094,397 |
| Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda | 25,134 | 40,220 | | | |
| Inversión en instrumentos de deuda por reporto | 90,527 | 228,421 | TOTAL CAPITAL CONTABLE | 11,215,145 | 11,573,570 |
| Plus (Minus) valía de valores por reporto | 157 | 456 | | | |
| Valores Prestados | 202,409 | 107,608 | | | |
| Plus (Minus) valía de valores prestados | (297) | (4,657) | | | |
| | 11,155,715 | 11,154,983 | | | |
| DEUDORES DIVERSOS | | | | | |
| Liquidadora | 16,990 | 386,056 | | | |
| Dividendos o derechos por cobrar | 6 | 489 | | | |
| Intereses devengados sobre valores | 130,623 | 139,087 | | | |
| Reportos | (156) | (455) | | | |
| Premios por cobrar por préstamo de valores | 8 | 3 | | | |
| Intereses devengados por instrumentos recibidos en reporto | 343 | 165 | | | |
| Intereses devengados sobre valores prestados | 4,100 | 1,835 | | | |
| Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC) | 743,735 | 1,208,382 | | | |
| | 895,649 | 1,735,562 | | | |
| | - | - | | | |
| TOTAL ACTIVO | 12,075,650 | 13,262,224 | TOTAL PASIVO MAS CAPITAL | 12,075,650 | 13,262,224 |

| Cuentas de Orden | 2018 | 2017 | Cuentas de Orden | 2018 | 2017 |
|---|------------|------------|---|---------------|---------------|
| Valores entregados en custodia | 10,805,279 | 10,820,173 | Capital social autorizado | 11,354,689 | 11,354,689 |
| Valores entregados en custodia por reporto | 90,870 | 228,587 | Acciones emitidas | 3,200,028,183 | 3,200,028,183 |
| Valores prestados | 202,112 | 102,951 | Acciones en circulación, posición propia | 10,896,419 | 12,050,709 |
| Garantías recibidas por préstamo de valores | 210,826 | 111,196 | Acciones de Siefores, posición de terceros | 1,127 | 1,127 |
| Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC) | 28,715 | 68 | Acciones en circulación propiedad de los trabajadores | 1,260,075,578 | 1,373,179,145 |
| Bancos divisas en moneda extranjera | 8,061 | 15,567 | | | |
| Dólares americanos | 794 | 13,130 | | | |
| Euros | 375 | 2,254 | | | |
| Yenes | 6,892 | 183 | | | |
| Divisas por recibir | 8 | 4,227 | | | |
| Dólares americanos | 8 | 4,227 | | | |
| Divisas por entregar | - | 16,809 | | | |
| Dólares americanos | - | 16,809 | | | |
| Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga | 33,846,781 | 45,291,173 | | | |
| Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera | 170,726 | 32,774 | | | |
| Contratos Adelantados sobre Dólar Americano | 1,447,607 | 2,793,875 | | | |
| Contratos Adelantados sobre Euros | 6,864 | 43,470 | | | |
| Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional | - | 5,208 | | | |
| Ctos.Opc./Rta.Variable Nac. | 65 | | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos | 11,925,027 | 14,074,646 | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano | 2,468,813 | 4,958,687 | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS | 1,108,474 | 1,379,564 | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos | 13,586,559 | 16,090,464 | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano | 2,843,722 | 5,912,485 | | | |
| Ctos.Swp./T.Var.Euros | 288,924 | | | | |
| Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta | 32,987,271 | 45,811,610 | | | |
| Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera | 8,076 | 9,253 | | | |
| Contratos Adelantados sobre Dólar Americano | 598,062 | 2,779,005 | | | |
| Contratos Adelantados sobre Euros | 20,532 | 185,403 | | | |
| Contratos Adelantados sobre Otras Divisas | 38,352 | 49,782 | | | |
| Ctos.Fut./Rta.Variable Nac. | 14,283 | | | | |
| Contratos Futuros sobre Renta Variable Extranjera | - | 77,986 | | | |
| Contratos Futuros sobre Dólar Americano | - | 259,560 | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos | 12,381,543 | 14,496,137 | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano | 2,825,723 | 5,740,564 | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS | 1,584,194 | 2,023,853 | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros | 387,298 | 87,616 | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos | 12,488,418 | 15,019,033 | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano | 2,640,790 | 5,083,418 | | | |

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

| | | | | |
|-----------------------------------|----|------------|----|------------|
| Una plus (minus) valía de: | \$ | 831,167 | \$ | 1,094,397 |
| Un valor de los activos netos de: | \$ | 11,215,145 | \$ | 11,573,570 |
| El precio de la acción de: | \$ | 8.824061 | \$ | 8.354975 |

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 2018 Y 2017

(Cifras en miles de pesos)

| | 2018 | 2017 |
|--|------------------|------------------|
| Ingresos por la venta de Valores | 1,158,188 | 2,211,966 |
| Intereses, dividendos, premios y derechos | 151,250 | 166,262 |
| Resultado cambiario / Otros productos | (2,608) | (18,384) |
| Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados | 8,905 | 64,122 |
| INGRESOS NETOS | 1,315,735 | 2,423,966 |
| Costo de ventas de valores | 1,121,826 | 2,107,765 |
| Gastos generales | 1,672 | 1,144 |
| Comisiones sobre saldos | 29,533 | 31,744 |
| Intereses sobre inversiones en valores a entregar | 5,229 | 10,042 |
| EGRESOS NETOS | 1,158,260 | 2,150,695 |
| UTILIDAD DE OPERACIÓN | 157,475 | 273,271 |
| OTROS RESULTADOS INTEGRALES PLUS (MINUS) VALÍAS | (48,485) | (19,798) |
| UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO | 108,990 | 253,473 |

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 2018, fueron aprobados los Estados Financieros al 31 de Diciembre de 2017, asimismo, los presentes Estados Financieros al 31 de Marzo de 2018 serán aprobados en la Sesión del Consejo de Administración que se llevará a cabo el próximo 23 de Mayo de 2018.