

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 31 DE DICIEMBRE DE 2017 Y 2016

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2017	2016	PASIVO	2017	2016
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	10	9	Acreedores	323,459	25,098
Bancos monedas extranjeras	522,563	1,822,245	Provisiones para gastos	15,499	8,480
Divisas por recibir		1	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	7,085,002	8,307,550
	522,573	1,822,255	TOTAL PASIVO	7,423,960	8,341,128
INVERSIONES					
Inversión en valores de renta variable	11,642,028	12,057,877			
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	2,358,747	2,525,622			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	34,303,713	22,418,105			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	1,819,608	1,245,130			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	32,010,268	29,344,786			
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(1,704,142)	(2,692,340)			
Inversiones tercerizadas	2,147,455				
Plus (Minus) valía en Inversiones tercerizadas	483,881				
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	6,967,898	5,835,211			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	1,035,665	948,262			
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	1,845,585	2,117,374			
Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	66,217	50,511			
Inversión en FIBRAS	3,508,940	2,985,812			
Plus (Minus) valía en Inversion en FIBRAS	(462,455)	(333,728)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	514,284	435,528			
Inversión en valores extranjeros de deuda	362,884	3,153,214			
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	35,124	57,639			
Inversión en títulos Fiduciarios	4,439,866	3,847,631			
Plus (minus) valía en Títulos Fiduciarios	935,430	1,043,804			
Inversión en instrumentos de deuda por reporto	4,048,375	7,350,124			
Plus (Minus) valía de valores por reporto	4,625	5,512			
Valores Prestados	648,619	-			
Plus (Minus) valía de valores prestados	(19,354)	-			
	106,993,261	92,396,074			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	130,138	502,682			
Dividendos o derechos por cobrar	62,364	4,492			
Intereses devengados sobre valores	642,105	469,484			
Reportos	(4,661)	(5,500)			
Premios por cobrar por préstamo de valores	30	-			
Intereses devengados por instrumentos recibidos en reporto	14,841	31,981			
Intereses devengados sobre valores prestados	2,635	-			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	6,346,773	8,107,693			
	7,194,225	9,110,832			
TOTAL ACTIVO	114,710,059	103,329,160			
			CAPITAL CONTABLE	2017	2016
			CAPITAL		
			CAPITAL CONTRIBUIDO	58,656,907	56,599,622
			Capital social pagado	50,446,123	49,437,869
			Prima en venta de acciones	8,210,784	7,161,753
			CAPITAL GANADO	44,080,471	35,543,512
			Resultados de ejercicios anteriores	35,543,512	33,408,562
			Resultados del ejercicio	8,536,959	2,134,950
			OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
			PLUS (MINUS) VALÍAS	4,548,721	2,844,899
			TOTAL CAPITAL CONTABLE	107,286,099	94,988,033
			TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	114,710,059	103,329,161

CUENTAS DE ORDEN	2017	2016	CUENTAS DE ORDEN	2017	2016
Valores entregados en custodia	101,796,713	84,604,910	Capital social autorizado	126,259,200	126,259,200
Valores entregados en custodia por reporto	4,063,179	7,382,117	Acciones emitidas	25,000,019,801	25,000,019,801
Valores prestados	629,265	-	Acciones en circulación, posición propia	73,680,993	71,476,169
Garantías recibidas por valores prestados	663,041	-	Acciones de Siefores, posición de terceros	2	2
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	678,413	325,244	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	9,914,930,336	9,717,495,194
Bancos divisas en moneda extranjera	93,026	87,938			
Dólares americanos	24,773	79,197			
Euros	1,004	8,719			
Yenes	67,249	22			
Divisas por recibir		3			
Yenes		3			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	2,905,132	2,811,782			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	302,827,710	307,508,404			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	14,590,913	10,116,893			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	20,729,755	13,879,473			
Contratos Adelantados sobre Euros	1,999,811	164,676			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas		671,701			
Contratos Futuros sobre Renta Fija (Tasas)	2,887,366	26,174,695			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional		781,890			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Extranjera	108,423	639,267			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano		498,713			
Contratos Opc. Renta Variable Nacional	2,894				
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	99,446,619	91,836,395			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	22,827,221	26,575,504			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	6,264,419	7,069,463			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	100,334,181	91,653,378			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	31,577,288	37,239,302			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	2,058,820	207,054			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	285,086,245	287,807,275			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	109,281	833,240			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	9,665,523	21,171,671			
Contratos Adelantados sobre Euros	3,473,870	1,523,832			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	1,106,637	1,280,119			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	193,440				
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	7,971,789	8,408,859			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	95,285,243	85,148,841			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	31,787,499	35,909,546			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	9,226,727	10,666,851			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	2,908,614	763,249			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	98,984,528	93,979,690			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	24,373,094	28,121,377			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$	4,548,721	\$	2,844,899
Un valor de los activos netos de:	\$	107,286,099	\$	94,988,033
El precio de la acción de:	\$	10.740842	\$	9.703577

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 31 DE DICIEMBRE DE 2017 Y 2016

(Cifras en miles de pesos)

	2017	2016
Ingresos por la venta de Valores	52,132,808	50,336,576
Intereses, dividendos, premios y derechos	5,891,795	5,039,719
Resultado cambiario / Otros productos	(510,324)	518,228
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	3,330,421	(4,307,911)
INGRESOS NETOS	60,844,700	51,586,612
Costo de ventas de valores	50,807,723	48,247,461
Gastos generales	73,608	51,309
Comisiones sobre saldos	1,102,760	1,014,340
Comisiones por servicios de tercerización	9,447	
Intereses sobre inversiones en valores a entregar	314,203	138,552
EGRESOS NETOS	52,307,741	49,451,662
UTILIDAD DE OPERACIÓN	8,536,959	2,134,950
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	1,703,823	(1,587,074)
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	10,240,782	547,876

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 7 de Noviembre de 2017, fueron aprobados los Estados Financieros al 30 de Septiembre de 2017 y 2016, asimismo, los presentes Estados Financieros al 31 Diciembre de 2017 y 2016 fueron aprobados en la Sesión del Consejo de Administración con fecha 28 de Febrero de 2018.