

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 30 DE JUNIO DE 2015 Y DE 2014
(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2015	2014	PASIVO	2015	2014
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	10	10	Acreedores	31,206	2,297
Bancos monedas extranjeras	57,914	30,972	Provisiones para gastos	440	426
Divisas por recibir	820	151	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	1,049,622	1,411,246
	58,744	31,133	TOTAL PASIVO	1,081,269	1,413,970
INVERSIONES			CAPITAL CONTABLE	2015	2014
Inversión en valores de renta variable	362,655	396,001	CAPITAL		
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	206,329	116,255	CAPITAL CONTRIBUIDO	4,067,742	4,467,949
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	5,873,263	6,099,295	Capital social pagado	6,056,542	6,216,027
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	971,980	1,103,821	Prima en venta de acciones	(1,988,801)	(1,748,078)
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	4,480,232	3,674,181	CAPITAL GANADO	8,051,877	7,422,588
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	130,962	263,301	Resultados de ejercicios anteriores	7,708,277	7,156,177
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	405,744	656,585	Resultados del ejercicio	343,599	266,411
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	73,862	62,360	OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	23,097	-	PLUS (MINUS) VALÍAS	1,445,839	1,618,891
Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	1,253	-	TOTAL CAPITAL CONTABLE	13,565,458	13,509,428
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	45,189	124,356			
Inversión en valores extranjeros de deuda	531,412	520,863	TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	14,646,727	14,923,398
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	61,454	73,154			
Inversión en instrumentos de deuda por reporto	416,449	484,858			
Plus (Minus) valía de valores por reporto	490	1			
	13,584,370	13,575,031			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	43	543			
Dividendos o derechos por cobrar	3,672	3,639			
Intereses devengados sobre valores	79,139	77,131			
Reportos	(487)	(0)			
Intereses devengados por instrumentos recibidos en reporto	215	778			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	921,031	1,235,143			
	1,003,613	1,317,234			
TOTAL ACTIVO	14,646,727	14,923,398			

CUENTAS DE ORDEN	2015	2014	CUENTAS DE ORDEN	2015	2014
Valores entregados en custodia	13,122,243	12,965,816	Capital social autorizado	11,354,689	11,354,689
Valores entregados en custodia por reporto	416,667	485,637	Acciones emitidas	3,200,028,183	3,200,028,183
Bancos divisas en moneda extranjera	17,152	3,682	Acciones en circulación, posición propia	15,050,092	15,047,554
Dólar americano	3,370	1,889	Acciones de Siefiores, posición de terceros	1,127	1,127
Euros	189	354	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	1,691,830,091	1,736,779,177
Yenes	13,592	1,439			
Divisas por recibir	52	12			
Dólar americano	52	12			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	34,313,528	34,940,823			
Contratos Adelantados sobre Renta Fija (Bonos)	46,381	90,199			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	27,407	39,057			
Contratos Adelantados sobre Dólar americano	77,900	-			
Contratos Adelantados sobre Yenes	6,626	-			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	9,498	68,011			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	10,760,636	11,758,667			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar americano	3,303,846	2,944,419			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	1,352,800	1,142,893			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	13,897,335	14,889,255			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar americano	4,831,099	4,008,323			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	35,646,244	35,900,409			
Contratos Adelantados sobre Dólar americano	242,604	8,362			
Contratos Adelantados sobre Euros	442,049	264,473			
Contratos Adelantados sobre Yenes	5,657	5,601			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	45,168	-			
Contratos Futuros sobre Renta Fija (Bonos)	-	15,117			
Contratos Futuros sobre Dólar americano	765,652	864,147			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	12,295,037	12,786,956			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar americano	4,594,174	3,795,327			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	1,879,079	2,379,004			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	204,344	204,344			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	11,697,549	12,461,573			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar americano	3,474,930	3,115,503			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$	1,445,839	\$	1,618,891
Un valor de los activos netos de:	\$	13,565,458	\$	13,509,428
El precio de la acción de:	\$	7.947511	\$	7.711619

LUIS ROBERTO GUZMÁN GONZÁLEZ

Contador General de SIEFORE

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

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 30 DE JUNIO DE 2015 Y DE 2014**

(Cifras en miles de pesos)

	2015	2014
Ingresos por la venta de Valores	1,348,326	1,080,622
Intereses, dividendos, premios y derechos	355,526	349,366
Resultado cambiario / Otros productos	52,658	(8,751)
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	(73,125)	(37,155)
INGRESOS NETOS	1,683,386	1,384,082
Costo de ventas de valores	1,252,260	1,034,695
Gastos generales	535	775
Comisiones sobre saldos	76,168	75,977
Intereses sobre inversiones en valores a entregar	10,824	6,223
EGRESOS NETOS	1,339,786	1,117,671
UTILIDAD DE OPERACIÓN	343,599	266,411
OTROS RESULTADOS INTEGRALES PLUS (MINUS) VALÍAS	1,445,839	1,618,891
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	1,789,439	1,885,302

LUIS ROBERTO GUZMÁN GONZÁLEZ

Contador General de SIEFORE

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

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.