

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 30 DE SEPTIEMBRE DE 2015 Y 2014

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2015	2014	PASIVO	2015	2014
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	10	10	Acreedores		48,709
Bancos monedas extranjeras	47,962	37,883	Provisiones para gastos	407	431
	47,972	37,893	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	1,175,998	1,108,547
INVERSIONES			TOTAL PASIVO	1,176,405	1,157,687
Inversión en valores de renta variable	351,920	385,291			
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	171,308	140,492			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	5,697,947	6,078,477			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	869,179	994,605			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	4,220,284	4,104,979			
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	102,891	149,693			
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	377,410	421,092			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	87,371	31,224			
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	19,306				
Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	60				
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	33,100	65,671			
Inversión en valores extranjeros de deuda	531,412	520,863			
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	59,260	63,553			
Inversión en instrumentos de deuda por reporto	644,800	186,150			
Plus (Minus) valía de valores por reporto	1,283	7			
Valores Prestados	34,889				
Plus (Minus) valía de valores prestados	71				
	13,202,491	13,142,097			
DEUDORES DIVERSOS			CAPITAL CONTABLE	2015	2014
Liquidadora	231		CAPITAL		
Dividendos o derechos por cobrar	778	1,036	CAPITAL CONTRIBUIDO	3,760,987	4,129,108
Intereses devengados sobre valores	168,068	167,319	Capital social pagado	5,920,004	6,060,703
Reportos	(1,283)	(6)	Prima en venta de acciones	(2,159,017)	(1,931,595)
Premios por cobrar por préstamo de valores	2		CAPITAL GANADO	8,154,301	7,625,091
Intereses devengados por instrumentos recibidos en reporto	675	421	Resultados de ejercicios anteriores	7,708,277	7,156,177
Intereses devengados sobre valores prestados	511		Resultados del ejercicio	446,024	468,914
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	962,387	942,693	OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
	1,131,369	1,111,463	PLUS (MINUS) VALÍAS	1,290,139	1,379,567
TOTAL ACTIVO	14,381,832	14,291,453	TOTAL CAPITAL CONTABLE	13,205,427	13,133,766
			TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	14,381,832	14,291,453

CUENTAS DE ORDEN	2015	2014	CUENTAS DE ORDEN	2015	2014
Valores entregados en custodia	12,488,347	12,890,269	Capital social autorizado	11,354,689	11,354,689
Valores entregados en custodia por reporto	645,476	186,572	Acciones emitidas	3,200,028,183	3,200,028,183
Valores prestados	34,960		Acciones en circulación, posición propia	15,053,855	15,047,554
Garantías recibidas por préstamo de valores	37,399		Acciones de Siefores, posición de terceros	1,127	1,127
Bancos divisas en moneda extranjera	18,441	48,517	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	1,653,346,777	1,693,005,285
Dólares americanos	2,541	709			
Euros	148	1,336			
Yenes	15,752	46,472			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	35,322,140	32,866,336			
Contratos Adelantados sobre Renta Fija (Bonos)	191,759	99,496			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	58,828	47,998			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	82,356	125,562			
Contratos Adelantados sobre Euros	145,466				
Contratos Adelantados sobre Yenes	1,118				
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	9,114	17,886			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	11,000,212	10,361,025			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	3,046,260	2,944,419			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	1,356,968	1,216,297			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	14,606,465	13,724,031			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	4,823,594	4,329,622			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	36,484,687	33,760,540			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	15,255				
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	823,824	26,746			
Contratos Adelantados sobre Euros	309,450	285,505			
Contratos Adelantados sobre Yenes	751	5,657			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	503,296	868,104			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	13,004,167	11,621,733			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	4,591,706	4,116,626			
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	11,932,365	11,137,318			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	3,220,450	3,115,503			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$	1,290,139	\$	1,379,567
Un valor de los activos netos de:	\$	13,205,427	\$	13,133,766
El precio de la acción de:	\$	7.915017	\$	7.689316

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 30 DE SEPTIEMBRE DE 2015 Y 2014

(Cifras en miles de pesos)

CONCEPTO	2015	2014
Ingresos por la venta de Valores	2,776,894	1,722,780
Intereses, dividendos, premios y derechos	534,069	519,829
Resultado cambiario / Otros productos	69,330	7,487
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	(272,119)	(31,713)
INGRESOS NETOS	3,108,174	2,218,383
Costo de ventas de valores	2,535,068	1,624,656
Gastos generales	819	1,160
Comisiones sobre saldos	113,647	114,630
Intereses sobre inversiones en valores a entregar	12,616	9,023
EGRESOS NETOS	2,662,150	1,749,469
UTILIDAD DE OPERACIÓN	446,024	468,914
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	1,290,139	1,379,567
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	1,736,163	1,848,481

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 Agosto de 2015, fueron aprobados Los Estados Financieros al 30 de Junio 2015 y 2014,asimismo, los presentes Estados Financieros al 30 de Septiembre de 2015 y 2014 serán aprobados en la sesión de Consejo de Administración que se llevara que se llevara a cabo el próximo 8 de Diciembre de 2015