

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 2016 Y 2015

(Cifras en miles de pesos)

| ACTIVO | 2016 | 2015 | PASIVO | 2016 | 2015 |
|---|-------------------|-------------------|---|-------------------|-------------------|
| DISPONIBLE | | | OBLIGACIONES | | |
| Bancos moneda nacional | 10 | 10 | Provisiones para gastos | 442 | 436 |
| Bancos monedas extranjeras | 130,014 | 172,553 | Divisas por entregar | 6,895 | - |
| | 130,024 | 172,563 | Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC) | 1,361,568 | 1,157,256 |
| INVERSIONES | | | TOTAL PASIVO | 1,368,905 | 1,157,692 |
| Inversión en valores de renta variable | 374,718 | 379,917 | | | |
| Plus (Minus) valía en valores de renta variable | 182,077 | 203,695 | | | |
| Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís | 6,323,168 | 5,767,879 | | | |
| Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís | 902,497 | 976,411 | | | |
| Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos | 4,191,600 | 4,070,182 | | | |
| Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos | 113,805 | 212,203 | | | |
| Depósito Traspaso Banxico | 5,679 | 6,069 | | | |
| Plus (Minus) valía en inversión en el Depósito Traspaso Banxico | 66 | 31 | | | |
| Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso | 449,700 | 406,432 | CAPITAL | | |
| Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso | 105,337 | 74,005 | CAPITAL CONTRIBUIDO | 4,614,731 | 4,507,476 |
| Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados | 18,301 | 58,751 | Capital social pagado | 6,306,332 | 6,253,114 |
| Inversión en valores extranjeros de deuda | 356,722 | 531,412 | Prima en venta de acciones | (1,691,601) | (1,745,638) |
| Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda | 48,818 | 64,139 | CAPITAL GANADO | 8,324,687 | 7,887,306 |
| Inversión en instrumentos de deuda por reporto | 1,113,189 | 921,744 | Resultados de ejercicios anteriores | 8,386,593 | 7,708,277 |
| Plus (Minus) valía de valores por reporto | 391 | 506 | Resultados del ejercicio | (61,906) | 179,029 |
| | 14,186,068 | 13,673,376 | OTROS RESULTADOS INTEGRALES | | |
| DEUDORES DIVERSOS | | | PLUS (MINUS) VALÍAS | 1,352,600 | 1,530,483 |
| Liquidadora | 73 | 28 | TOTAL CAPITAL CONTABLE | 14,292,018 | 13,925,265 |
| Dividendos o derechos por cobrar | 1,077 | 874 | | | |
| Intereses devengados sobre valores | 170,627 | 162,793 | | | |
| Reportos | (390) | (536) | | | |
| Intereses devengados por instrumentos recibidos en reporto | 7,430 | 7,157 | | | |
| Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC) | 1,166,014 | 1,066,702 | | | |
| | 1,344,831 | 1,237,018 | | | |
| | - | - | | | |
| TOTAL ACTIVO | 15,660,923 | 15,082,957 | TOTAL PASIVO MAS CAPITAL | 15,660,923 | 15,082,957 |

| CUENTAS DE ORDEN | 2016 | 2015 | CUENTAS DE ORDEN | 2016 | 2015 |
|---|------------|------------|---|---------------|---------------|
| Valores entregados en custodia | 13,054,187 | 12,692,375 | Capital social autorizado | 11,354,689 | 11,354,689 |
| Valores entregados en custodia por reporto | 1,120,621 | 928,871 | Acciones emitidas | 3,200,028,183 | 3,200,028,183 |
| Bancos divisas en moneda extranjera | 28,657 | 17,251 | Acciones en circulación, posición propia | 15,053,855 | 15,050,092 |
| Dólares americanos | 4,984 | 10,872 | Acciones de Siefores, posición de terceros | 1,127 | 1,127 |
| Euros | 2,080 | 356 | Acciones en circulación propiedad de los trabajadores | 1,762,223,289 | 1,747,228,811 |
| Yenes | 21,593 | 6,023 | | | |
| Divisas por entregar | 400 | - | | | |
| Dólares americanos | 400 | - | | | |
| Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga | 37,744,353 | 33,010,273 | | | |
| Contratos Adelantados sobre Renta Fija (Bonos) | - | 385,650 | | | |
| Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera | 24,974 | 8,511 | | | |
| Contratos Adelantados sobre Dólar Americano | 1,174,479 | 31,580 | | | |
| Contratos Adelantados sobre Euros | 147,352 | 1,674 | | | |
| Contratos Adelantados sobre Yenes | - | 6,626 | | | |
| Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional | 9,326 | 9,172 | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos | 11,290,927 | 10,342,525 | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano | 4,103,685 | 3,132,693 | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS | 1,354,690 | 1,216,297 | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos | 14,617,103 | 13,460,357 | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano | 5,021,817 | 4,415,188 | | | |
| Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta | 37,861,863 | 33,699,016 | | | |
| Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera | 52,261 | 19,840 | | | |
| Contratos Adelantados sobre Dólar Americano | 805,182 | - | | | |
| Contratos Adelantados sobre Euros | 217,986 | 318,040 | | | |
| Contratos Adelantados sobre Yenes | - | 5,657 | | | |
| Contratos Adelantados sobre Otras Divisas | 94,754 | - | | | |
| Contratos Futuros sobre Renta Variable Extranjera | 9,293 | - | | | |
| Contratos Futuros sobre Dólar Americano | 295,298 | 789,087 | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos | 12,960,647 | 11,858,059 | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano | 4,789,929 | 4,178,263 | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS | 1,933,493 | 1,879,079 | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros | 204,344 | 204,344 | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos | 12,220,800 | 11,142,870 | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano | 4,277,876 | 3,303,777 | | | |

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

| | | | | |
|-----------------------------------|----|------------|----|------------|
| Una plus (minus) valía de: | \$ | 1,352,600 | \$ | 1,530,483 |
| Un valor de los activos netos de: | \$ | 14,292,018 | \$ | 13,925,265 |
| El precio de la acción de: | \$ | 8.041520 | \$ | 7.901846 |

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 2016 Y 2015

(Cifras en miles de pesos)

| | 2016 | 2015 |
|--|-----------------|----------------|
| Ingresos por la venta de Valores | 501,383 | 699,328 |
| Intereses, dividendos, premios y derechos | 185,747 | 175,930 |
| Resultado cambiario / Otros productos | (715) | 48,623 |
| Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados | (224,470) | (48,332) |
| INGRESOS NETOS | 461,945 | 875,549 |
| Costo de ventas de valores | 473,938 | 652,498 |
| Gastos generales | 375 | 249 |
| Comisiones sobre saldos | 37,066 | 38,023 |
| Intereses sobre inversiones en valores a entregar | 12,472 | 5,750 |
| EGRESOS NETOS | 523,851 | 696,520 |
| UTILIDAD DE OPERACIÓN | (61,906) | 179,029 |
| OTROS RESULTADOS INTEGRALES | | |
| PLUS (MINUS) VALÍAS | 272,989 | (155,516) |
| UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO | 211,083 | 23,513 |

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 febrero de 2016, fueron aprobados los Estados Financieros al 31 de Diciembre de 2015 y 2014, así mismo, los presentes Estados Financieros al 31 de Marzo de 2016 y 2015 serán aprobados en la Sesión del Consejo de Administración que se llevará a cabo el próximo 3 de Junio de 2016.