

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 31 DE DICIEMBRE DE 2016 Y 2015

(Cifras en miles de pesos)

| ACTIVO | 2016 | 2015 | PASIVO | 2016 | 2015 |
|---|-------------------|-------------------|---|-------------------|-------------------|
| DISPONIBLE | | | OBLIGACIONES | | |
| Bancos moneda nacional | 10 | 48 | Acreedores | 3,418 | - |
| Bancos monedas extranjeras | 125,469 | 60,312 | Provisiones para gastos | 1,183 | 1,722 |
| Divisas por recibir | - | 337 | Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC) | 1,360,134 | 1,005,303 |
| | 125,479 | 60,697 | TOTAL PASIVO | 1,364,735 | 1,007,025 |
| INVERSIONES | | | | | |
| Inversión en valores de renta variable | 280,920 | 330,243 | | | |
| Plus (Minus) valía en valores de renta variable | 200,090 | 199,999 | | | |
| Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis | 5,932,112 | 6,292,790 | | | |
| Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis | 883,516 | 683,207 | | | |
| Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos | 3,266,241 | 4,047,313 | | | |
| Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos | (206,259) | 56,638 | | | |
| Depósito Traspaso Banxico | - | 5,655 | | | |
| Plus (Minus) valía en inversión en el Depósito Traspaso Banxico | - | 3 | | | |
| Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso | 632,000 | 405,359 | | | |
| Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso | 186,387 | 84,016 | | | |
| Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas | 156,516 | 19,306 | | | |
| Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas | 7,304 | (104) | | | |
| Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados | 7,834 | 28,024 | | | |
| Inversión en valores extranjeros de deuda | 481,503 | 463,117 | | | |
| Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda | 43,158 | 55,851 | | | |
| Inversión en instrumentos de deuda por reporto | 805,660 | 1,798,535 | | | |
| Plus (Minus) valía de valores por reporto | 988 | 3,026 | | | |
| | 12,677,970 | 14,472,978 | | | |
| DEUDORES DIVERSOS | | | | | |
| Liquidadora | 35,627 | 38 | | | |
| Dividendos o derechos por cobrar | 3 | 158 | | | |
| Intereses devengados sobre valores | 84,267 | 89,958 | | | |
| Reportos | (992) | (3,356) | | | |
| Intereses devengados por instrumentos recibidos en reporto | 9,100 | 2,973 | | | |
| Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC) | 1,315,375 | 927,271 | | | |
| | 1,443,380 | 1,017,042 | | | |
| TOTAL ACTIVO | 14,246,829 | 15,550,717 | | | |
| | | | CAPITAL CONTABLE | 2016 | 2015 |
| | | | CAPITAL | | |
| | | | CAPITAL CONTRIBUIDO | 2,999,078 | 5,077,489 |
| | | | Capital social pagado | 5,583,756 | 6,512,506 |
| | | | Prima en venta de acciones | (2,584,678) | (1,435,017) |
| | | | CAPITAL GANADO | 8,768,821 | 8,386,593 |
| | | | Resultados de ejercicios anteriores | 8,386,593 | 7,708,277 |
| | | | Resultados del ejercicio | 382,228 | 678,316 |
| | | | OTROS RESULTADOS INTEGRALES | | |
| | | | PLUS (MINUS) VALÍAS | 1,114,195 | 1,079,610 |
| | | | TOTAL CAPITAL CONTABLE | 12,882,094 | 14,543,692 |
| | | | TOTAL PASIVO MAS CAPITAL | 14,246,829 | 15,550,717 |

| CUENTAS DE ORDEN | 2016 | 2015 | CUENTAS DE ORDEN | 2016 | 2015 |
|---|-------------------|-------------------|---|---------------|---------------|
| Valores entregados en custodia | 11,863,487 | 12,643,393 | Capital social autorizado | 11,354,689 | 11,354,689 |
| Valores entregados en custodia por reporto | 814,756 | 1,801,177 | Acciones emitidas | 3,200,028,183 | 3,200,028,183 |
| Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC) | 16,539 | - | Acciones en circulación, posición propia | 12,050,709 | 15,053,855 |
| Bancos divisas en moneda extranjera | 5,794 | 24,718 | Acciones de Siefores, posición de terceros | 1,127 | 1,127 |
| Dólares americanos | 278 | 890 | Acciones en circulación propiedad de los trabajadores | 1,561,586,780 | 1,820,328,134 |
| Euros | 5,516 | 2,235 | | | |
| Yenes | - | 21,593 | | | |
| Divisas por recibir | - | 20 | | | |
| Dólares americanos | - | 20 | | | |
| Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga | 40,717,549 | 36,048,748 | | | |
| Contratos Adelantados sobre Renta Fija (Bonos) | - | 145,378 | | | |
| Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera | 31,629 | 26,281 | | | |
| Contratos Adelantados sobre Dólar Americano | 1,287,618 | 88,238 | | | |
| Contratos Adelantados sobre Euros | 37,019 | 132,408 | | | |
| Contratos Adelantados sobre Otras Divisas | 13,920 | - | | | |
| Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional | 9,803 | 9,203 | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos | 13,150,846 | 11,247,777 | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano | 4,618,715 | 3,046,260 | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS | 1,379,564 | 1,370,887 | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos | 14,809,071 | 15,026,015 | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano | 5,379,364 | 4,956,301 | | | |
| Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta | 41,462,489 | 37,219,256 | | | |
| Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera | 24,788 | 42,377 | | | |
| Contratos Adelantados sobre Dólar Americano | 1,811,325 | 811,873 | | | |
| Contratos Adelantados sobre Euros | - | 216,669 | | | |
| Contratos Adelantados sobre Otras Divisas | 34,331 | 58,178 | | | |
| Contratos Futuros sobre Renta Variable Extranjera | 73,806 | - | | | |
| Contratos Futuros sobre Dólar Americano | 146,146 | 444,031 | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos | 13,156,137 | 13,391,447 | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano | 5,207,443 | 4,724,413 | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS | 2,023,853 | 1,911,624 | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros | 145,980 | 204,344 | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos | 14,095,234 | 12,193,850 | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano | 4,743,446 | 3,220,450 | | | |

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

| | | | | |
|-----------------------------------|----|------------|----|------------|
| Una plus (minus) valía de: | \$ | 1,114,195 | \$ | 1,079,610 |
| Un valor de los activos netos de: | \$ | 12,882,094 | \$ | 14,543,692 |
| El precio de la acción de: | \$ | 8.186183 | \$ | 7.924064 |

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 DICIEMBRE DE 2016 Y 2015

(Cifras en miles de pesos)

| | 2016 | 2015 |
|--|------------------|------------------|
| Ingresos por la venta de Valores | 3,802,908 | 3,359,562 |
| Intereses, dividendos, premios y derechos | 739,170 | 721,905 |
| Resultado cambiario / Otros productos | (1,519) | 81,118 |
| Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados | (302,383) | (230,996) |
| INGRESOS NETOS | 4,238,176 | 3,931,589 |
| Costo de ventas de valores | 3,663,164 | 3,080,012 |
| Gastos generales | 8,955 | 961 |
| Comisiones sobre saldos | 150,020 | 152,535 |
| Intereses sobre inversiones en valores a entregar | 33,809 | 19,765 |
| EGRESOS NETOS | 3,855,948 | 3,253,273 |
| UTILIDAD DE OPERACIÓN | 382,228 | 678,316 |
| OTROS RESULTADOS INTEGRALES | | |
| PLUS (MINUS) VALÍAS | 34,585 | 1,079,610 |
| UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO | 416,813 | 1,757,926 |

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 6 de Diciembre de 2016, fueron aprobados los Estados Financieros al 30 de Septiembre de 2016 y 2015, asimismo, los presentes Estados Financieros al 31 Diciembre de 2016 y 2015 fueron aprobados en la Sesión del Consejo de Administración con fecha 28 de Febrero de 2017.