

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 JUNIO DE 2019 Y 2018

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2019	2018	PASIVO	2019	2018
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	64	10	Acreedores	5,166	39,670
Bancos monedas extranjeras	10,423	15,048	Provisiones para gastos	1,024	928
Divisas por recibir	619		Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	736,402	906,797
	11,106	15,058	TOTAL PASIVO	742,592	947,395
INVERSIONES			CAPITAL CONTABLE	2019	2018
Inversión en valores de renta variable	676,629	554,820	CAPITAL		
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	35,340	73,751	CAPITAL CONTRIBUIDO	(133,683)	(408,141)
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	5,347,828	5,659,219	Capital social pagado	4,359,623	4,205,663
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	927,644	706,380	Prima en venta de acciones	(4,493,306)	(4,613,804)
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	2,964,128	2,523,251	CAPITAL GANADO	10,981,667	10,260,760
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(16,101)	(89,210)	Resultados de ejercicios anteriores	10,569,100	9,871,107
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	558,999	462,186	Resultados del ejercicio	412,567	389,653
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	98,208	100,795	OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	386,942	213,793	PLUS (MINUS) VALÍAS	1,144,228	804,317
Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	10,299	7,797	TOTAL CAPITAL CONTABLE	11,992,212	10,656,936
Inversión en FIBRAS	2,759	2,759			
Plus (Minus) valía en Inversion en FIBRAS	(221)	(81)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados		2,306			
Inversión en valores extranjeros de deuda	139,537	164,120			
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	17,129	23,020			
Inversión en instrumentos de deuda por reporto	7,255	64,540			
Plus (Minus) valía de valores por reporto	22	72			
Valores Prestados	859,370	241,784			
Plus (Minus) valía de valores prestados	71,930	(18,135)			
	12,087,697	10,693,167			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	1,575	51,198			
Dividendos o derechos por cobrar		207			
Intereses devengados sobre valores	77,981	78,030			
Reportos	(22)	(72)			
Premios por cobrar por préstamo de valores	68	9			
Intereses devengados por instrumentos recibidos en reporto	30	154			
Intereses devengados sobre valores prestados	9,697	844			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	546,672	765,736			
	636,001	896,106			
TOTAL ACTIVO	12,734,804	11,604,331	TOTAL PASIVO Y CAPITAL CONTABLE	12,734,804	11,604,331

CUENTAS DE ORDEN	2019	2018	CUENTAS DE ORDEN	2019	2018
Valores entregados en custodia	10,995,919	10,371,200	Capital social autorizado	11,354,689	11,354,689
Valores entregados en custodia por reporte	7,285	64,694	Acciones emitidas	3,200,028,183	3,200,028,183
Valores prestados	931,301	223,649	Acciones en circulación, posición propia	9,073,088	8,988,961
Garantías recibidas por Valores Prestados	992,421	236,638	Acciones de Siefres, posición de terceros	1,127	1,127
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	79,482	60,513	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	1,219,573,826	1,176,268,069
Bancos divisas en moneda extranjera	5,748	7,555			
Dólares americanos	490	433			
Euros	3	231			
Yenes	5,255	6,891			
Divisas por recibir	28				
Euros	28				
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	29,092,503	30,048,789			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	127,395	170,456			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	1,732,000	1,432,851			
Contratos Adelantados sobre Euros	92,739	42,141			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas		38,255			
Contratos de Opciones sobre Renta Variable Nacional	52	65			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	9,482,184	10,843,657			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	2,514,745	1,889,628			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	957,346	1,108,474			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	307,722	173,098			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	11,452,508	12,344,986			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	2,136,888	1,716,254			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	288,924	288,924			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	28,665,658	29,464,245			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	76,432	35,716			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	1,383,659	948,574			
Contratos Adelantados sobre Euros	13,377	20,532			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas		38,352			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	46,823	13,725			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano		42,356			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	10,429,172	11,149,358			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	2,455,573	1,791,530			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	1,052,913	1,395,053			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	376,092	387,298			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	9,939,299	11,407,048			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	2,584,596	2,061,605			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	307,722	173,098			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$ 1,144,228	\$ 804,317
Un valor de los activos netos de:	\$ 11,992,212	\$ 10,656,936
El precio de la acción de:	\$ 9.760494	\$ 8.991236

GABRIEL VILLAGÓMEZ GÓMEZ
Contador General de SIEFORE

LUIS ARMANDO KURI HENAINE
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 JUNIO DE 2019 Y 2018

(Cifras en miles de pesos)

	2019	2018
Ingresos por la venta de Valores	2,475,127	1,778,579
Intereses, dividendos, premios y derechos	321,828	291,932
Resultado cambiario / Otros productos	(2,288)	3,534
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	20,818	97,702
INGRESOS NETOS	2,815,485	2,171,747
Costo de ventas de valores	2,334,168	1,714,571
Gastos generales	6,367	3,706
Comisiones sobre saldos	59,697	57,310
Intereses sobre inversiones en valores a entregar	2,686	6,507
EGRESOS NETOS	2,402,918	1,782,094
UTILIDAD DE OPERACIÓN	412,567	389,653
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	441,661	(75,336)
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	854,228	314,317

GABRIEL VILLAGÓMEZ GÓMEZ
Contador General de SIEFORE

LUIS ARMANDO KURI HENAINE
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 28 de mayo de 2019, fueron aprobados los Estados Financieros al 31 de Marzo de 2019, asimismo, los presentes Estados Financieros al 30 de junio de 2019 serán aprobados en la Sesión del Consejo de Administración que se llevará a cabo el próximo 14 de agosto de 2019.