

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

**SIEFORE SURA BÁSICA 2, 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 2015 Y 2014

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2015	2014	PASIVO	2015	2014
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	179	1,128	Acreedores		421,866
Bancos monedas extranjeras	1,171,809	449,477	Provisiones para gastos	16,225	7,945
Divisas por recibir	2,065	1,087	Divisas por entregar	655,451	
	1,174,053	451,692	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	4,400,362	4,876,640
INVERSIONES			TOTAL PASIVO	5,072,038	5,306,451
Inversión en valores de renta variable	15,572,826	14,085,852			
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	5,185,295	4,278,895			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	38,684,158	33,955,566			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	1,849,563	4,677,714			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	54,048,031	42,312,609			
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	136,857	2,227,034			
Depósito Traspaso Banxico	242,510	254,733			
Plus (Minus) valía en inversión en el Depósito Traspaso Banxico	117	66			
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	2,293,480	2,616,060			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	629,141	480,891			
Inversión en FIBRAS	3,644,278	2,339,160			
Plus (Minus) valía en Inversión en FIBRAS	122,893	516,071			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	599,889	988,003			
Inversión en valores extranjeros de deuda	1,879,930	1,986,825			
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	247,480	275,493			
Inversión en títulos Fiduciarios	4,599,475	3,842,925			
Plus (minus) valía en Títulos Fiduciarios	1,101,807	1,296,528			
Inversión en instrumentos de deuda por reporto	3,542,136	4,810,023			
Plus (Minus) valía de valores por reporto	2,738	5,579			
Valores Prestados	472,797				
Plus (Minus) valía de valores prestados	(31,470)				
	134,823,931	120,950,027			
DEUDORES DIVERSOS			CAPITAL CONTABLE	2015	2014
Liquidadora	660,149	516,007	CAPITAL		
Dividendos o derechos por cobrar	11,308	10,118	CAPITAL CONTRIBUIDO	41,194,543	27,547,656
Intereses devengados sobre valores	636,837	500,063	Capital social pagado	15,764,539	14,110,582
Reportos	(2,806)	(5,564)	Prima en venta de acciones	25,430,004	13,437,074
Premios por cobrar por préstamo de valores	50		CAPITAL GANADO	85,686,989	80,426,424
Intereses devengados por instrumentos recibidos en reporto	5,955	9,104	Resultados de ejercicios anteriores	80,426,423	75,606,878
Intereses devengados sobre valores prestados	8,545		Resultados del ejercicio	5,260,566	4,819,546
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	3,877,232	4,601,776	OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
	5,197,270	5,631,504	PLUS (MINUS) VALÍAS	9,241,684	13,752,692
	-	-	TOTAL CAPITAL CONTABLE	136,123,216	121,726,772
TOTAL ACTIVO	141,195,254	127,033,223	TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	141,195,254	127,033,223

CUENTAS DE ORDEN	2015	2014	CUENTAS DE ORDEN	2015	2014
Valores entregados en custodia	130,237,841	115,146,424	Capital social autorizado	27,500,100	27,500,100
Valores entregados en custodia por reporto	3,548,023	4,819,142	Acciones emitidas	27,500,100,000	27,500,100,000
Valores prestados	441,327		Acciones en circulación, posición propia	116,875,610	104,478,232
Garantías recibidas por préstamo de valores	485,555		Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	15,647,663,605	14,006,103,722
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	8,167				
Bancos divisas en moneda extranjera	478,135	1,699,098			
Dólares americanos	63,725	16,166			
Euros	709	226			
Yenes	413,701	1,682,706			
Divisas por recibir	120	74			
Dólares americanos	120	74			
Divisas por entregar	38,000				
Dólares americanos	38,000				
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	3,203,627	1,708,585			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	217,492,341	174,585,806			
Contratos Adelantados sobre Renta Fija (Bonos)	590,967	1,872,332			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	7,207,914	7,896,507			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	1,663,704	84,069			
Contratos Adelantados sobre Euros	1,084,002				
Contratos Adelantados sobre Yenes	142,350	274,892			
Contratos Futuros sobre Renta Fija (Tasas)	18,841,569	28,779,855			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	50,537,517	37,650,542			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	16,305,530	12,516,829			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	3,774,898	2,298,415			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	75,108,262	52,221,252			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	42,108,210	30,863,695			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	127,418	127,418			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	216,180,362	156,549,999			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	13,469,323				
Contratos Adelantados sobre Euros	2,968,644	4,286,921			
Contratos Adelantados sobre Yenes	1,579,398	1,545,908			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	563,543				
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	9,582,100	14,910,569			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	70,262,275	47,590,782			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	40,901,164	29,628,440			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	6,848,185	6,707,336			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	585,699	585,700			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	52,728,813	38,391,827			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	16,691,218	12,902,516			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$	9,241,684	\$	13,752,692
Un valor de los activos netos de:	\$	136,123,216	\$	121,726,772
El precio de la acción de:	\$	8.634773	\$	8.626630

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 2, 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 2015 Y 2014

(Cifras en miles de pesos)

	2015	2014
Ingresos por la venta de Valores	34,279,483	25,453,469
Intereses, dividendos, premios y derechos	6,454,077	5,399,750
Resultado cambiario / Otros productos	874,294	362,640
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	(2,955,320)	(1,125,159)
INGRESOS NETOS	38,652,534	30,090,700
Costo de ventas de valores	31,823,929	23,881,701
Gastos generales	20,839	21,323
Comisiones sobre saldos	1,407,680	1,189,280
Intereses sobre inversiones en valores a entregar	139,520	178,850
EGRESOS NETOS	33,391,968	25,271,154
	-	
UTILIDAD DE OPERACIÓN	5,260,566	4,819,546
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	9,241,684	13,752,692
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	14,502,250	18,572,238

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 27 de Noviembre 2015, fueron aprobados los Estados Financieros al 30 de Septiembre 2015 y 2014, así mismo, los presentes Estados Financieros al 31 de Diciembre de 2015 y 2014 serán aprobados en la sesión de Consejo de Administración que se llevara a cabo el próximo 4 de Febrero del 2016.