

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 30 DE JUNIO DE 2019 Y 2018

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2019	2018	PASIVO	2019	2018
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	1,498	10	Divisas por entregar	123,235	114,606
Bancos monedas extranjeras	49,332	73,053	Acreedores	877,002	638,638
Divisas por recibir	126,579		Provisiones para gastos	23,171	21,020
	177,409	73,063	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	5,851,811	6,354,523
RESERVADOS					
Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en MN	15,768				
	15,768				
INVERSIONES			TOTAL PASIVO	6,875,219	7,128,787
Inversión en valores de renta variable	23,490,747	20,950,559			
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	965,394	2,810,083			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	76,805,654	72,848,352			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	8,525,518	4,343,694			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	58,028,789	46,730,569			
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(636,029)	(2,283,396)			
Inversiones tercerizadas	3,250,938	3,250,938			
Plus (Minus) valía en Inversiones tercerizadas	734,078	528,382			
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	7,922,760	10,431,985			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	739,800	791,152			
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	2,832,047	2,380,442			
Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	28,554	47,502			
Inversión en FIBRAS	6,493,025	5,962,147			
Plus (Minus) valía en Inversion en FIBRAS	(1,296,189)	(897,287)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	2,918	16,456			
Inversión en valores extranjeros de deuda	518,916	656,864			
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	60	35,605			
Inversión en títulos Fiduciarios	10,432,163	7,624,889			
Plus (minus) valía en Títulos Fiduciarios	2,162,605	1,905,887			
Inversión en instrumentos de deuda por reporto	4,148,904	4,824,951			
Plus (Minus) valía de valores por reporto	11,851	7,886			
Valores Prestados	7,846,089	4,220,114			
Plus (Minus) valía de valores prestados	599,469	(23,983)			
	213,608,061	187,163,791			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	21,928	902,746			
Dividendos o derechos por cobrar		99,024			
Intereses devengados sobre valores	1,155,565	1,078,713			
Reportos	(11,841)	(7,874)			
Premios por cobrar por préstamo de valores	653	344			
Intereses devengados por instrumentos recibidos en reporto	18,559	20,591			
Intereses devengados sobre valores prestados	125,247	44,508			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	4,764,499	4,631,781			
			CAPITAL CONTABLE	2019	2018
			CAPITAL		
			CAPITAL CONTRIBUIDO	83,647,322	70,977,282
			Capital social pagado	20,424,386	19,104,836
			Prima en venta de acciones	63,222,936	51,872,446
			CAPITAL GANADO	117,530,046	108,642,979
			Resultados de ejercicios anteriores	110,415,764	103,012,585
			Resultados del ejercicio	7,114,282	5,630,394
			OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
			PLUS (MINUS) VALÍAS	11,823,261	7,257,639
			TOTAL CAPITAL CONTABLE	213,000,629	186,877,900

	6,074,610	6,769,833			
TOTAL ACTIVO	219,875,848	194,006,687	TOTAL PASIVO Y CAPITAL CONTABLE	219,875,848	194,006,687

CUENTAS DE ORDEN	2019	2018	CUENTAS DE ORDEN	2019	2018
Valores entregados en custodia	200,498,630	177,554,768	Capital social autorizado	27,500,100	27,500,100
Valores entregados en custodia por reporto	4,167,473	4,845,553	Acciones emitidas	27,500,100,000	27,500,100,000
Valores prestados	8,445,558	4,196,131	Acciones en circulación, posición propia	151,659,527	141,878,631
Garantías recibidas por Valores Prestados	8,976,027	4,487,891	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	20,272,726,496	18,962,957,895
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	739,551	83,559			
Bancos divisas en moneda extranjera	19,074	124,752			
Dólares americanos	1,911	1,810			
Euros	441	682			
Yenes	16,722	122,260			
Divisas por recibir	6,579				
Dólares americanos	6,500				
Euros	79				
Divisas por entregar	6,416	5,820			
Dólares americanos	6,416	5,820			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	10,900,450	3,790,889			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	337,416,507	310,637,362			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	13,660,553	14,436,767			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	24,796,831	27,450,895			
Contratos Adelantados sobre Euros	2,598,474	1,670,755			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas		672,876			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Extranjera	52,252	147,334			
Contratos de Opciones sobre Renta Variable Nacional	3,101	3,511			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	94,872,225	92,624,998			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	40,806,520	22,976,623			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	3,250,080	3,669,358			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	3,454,436	2,247,090			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	110,520,793	109,088,308			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	40,082,920	32,330,525			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	3,318,322	3,318,322			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	322,375,863	293,426,392			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	3,652,318	1,043,478			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	20,550,276	22,900,089			
Contratos Adelantados sobre Euros	370,096	1,281,231			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas		675,758			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	1,035,362	350,700			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	309,853	794,547			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	105,596,904	103,415,820			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	44,309,189	35,212,268			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	5,049,284	6,448,633			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	4,296,034	4,439,458			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	92,016,209	90,560,158			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	41,735,902	24,057,162			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	3,454,436	2,247,090			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$ 11,823,261	\$ 7,257,639
Un valor de los activos netos de:	\$ 213,000,629	\$ 186,877,900
El precio de la acción de:	\$ 10.428741	\$ 9.781706

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 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 30 DE JUNIO DE 2019 Y 2018

(Cifras en miles de pesos)

	2019	2018
Ingresos por la venta de Valores	18,246,312	21,783,292
Intereses, dividendos, premios y derechos	5,871,137	5,283,222
Resultado cambiario / Otros productos	(66,850)	(44,480)
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	2,209,357	1,264,682
INGRESOS NETOS	26,259,956	28,286,716
Costo de ventas de valores	17,861,961	21,452,567
Gastos generales	91,120	63,140
Comisiones sobre saldos	996,859	927,572
Comisiones por servicios de tercerización	10,120	9,552
Intereses sobre inversiones en valores a entregar	185,614	203,491
EGRESOS NETOS	19,145,674	22,656,322
UTILIDAD DE OPERACIÓN	7,114,282	5,630,394
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	10,118,248	(1,342,133)
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	17,232,530	4,288,261

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.