

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

**SIEFORE SURA BÁSICA 3, 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 SEPTIEMBRE DE 2016 Y 2015

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2016	2015	PASIVO	2016	2015
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	10	1,801	Divisas por entregar	637,125	79,907
Bancos monedas extranjeras	1,473,662	106,619	Acreedores	2,195,674	210,183
Divisas por recibir	1,848,827	291	Provisiones para gastos	13,287	4,102
	3,322,499	108,711	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	7,924,891	7,651,789
RESERVADOS					
Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en divisas	66,043	-			
	66,043	-			
INVERSIONES					
Inversión en valores de renta variable	17,037,021	17,253,462			
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	5,052,292	3,960,391			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	40,828,907	34,283,230			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	3,988,702	2,545,735			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	55,666,933	52,700,817			
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	836,474	461,769			
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	5,723,894	2,357,075			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	1,366,248	658,666			
Instrumentos otorgados en garantía por Operaciones Derivadas		199,626			
Plus Minus valia en Instrumentos otorgados en garantía por Operaciones Derivadas		1,528			
Inversión en FIBRAS	4,900,069	4,652,675			
Plus (Minus) valía en Inversion en FIBRAS	(24,219)	(79,462)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	1,070,181	653,014			
Inversión en valores extranjeros de deuda	1,158,264	2,031,490			
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	102,943	245,323			
Inversión en títulos Fiduciarios	6,372,267	5,851,457			
Plus (minus) valía en Títulos Fiduciarios	1,756,438	1,680,488			
Inversión en instrumentos de deuda por reporto	2,535,422	2,700,699			
Plus (Minus) valía de valores por reporto	5,136	6,515			
Valores Prestados	-	591,152			
Plus (Minus) valía de valores prestados	-	(11,841)			
	148,376,972	132,743,809			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	464,203	149,556			
Dividendos o derechos por cobrar	7,374	14,271			
Intereses devengados sobre valores	1,710,592	1,520,856			
Reportos	(5,044)	(6,512)			
Premios por cobrar por préstamo de valores	-	30			
Intereses devengados por instrumentos recibidos en reporto	1,226	2,956			
Intereses devengados sobre valores prestados	-	5,118			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	6,854,390	5,543,040			
	9,032,741	7,229,315			
			TOTAL PASIVO	10,770,977	7,945,981
			CAPITAL CONTABLE	2016	2015
			CAPITAL		
			CAPITAL CONTRIBUIDO	96,305,561	87,795,657
			Capital social pagado	79,684,815	75,095,432
			Prima en venta de acciones	16,620,746	12,700,225
			CAPITAL GANADO	40,642,840	34,877,600
			Resultados de ejercicios anteriores	38,506,997	32,894,933
			Resultados del ejercicio	2,135,843	1,982,667
			OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
			PLUS (MINUS) VALÍAS	13,078,877	9,462,597
			TOTAL CAPITAL CONTABLE	150,027,278	132,135,854

TOTAL ACTIVO	160,798,255	140,081,835
--------------	-------------	-------------

TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	160,798,255	140,081,835
--------------------------	-------------	-------------

CUENTAS DE ORDEN	2016	2015	CUENTAS DE ORDEN	2016	2015
Valores entregados en custodia	144,766,235	128,804,270	Capital social autorizado	126,259,200	126,259,200
Valores entregados en custodia por reporto	2,536,739	2,703,658	Acciones emitidas	25,000,019,801	25,000,019,801
Valores prestados	-	579,311	Acciones en circulación, posición propia	114,964,726	112,956,354
Garantías recibidas por valores prestados	-	624,740	Acciones de Siefores, posición de terceros	2	2
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	225,655	-	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	15,663,069,249	14,756,354,437
Bancos divisas en moneda extranjera	427,831	157,309			
Dólares americanos	47,830	5,026			
Euros	21,969	10			
Yenes	358,032	152,273			
Divisas por recibir	95,411	17			
Dólares americanos	95,411	17			
Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en moneda extranjera	3,408	-			
Dólares americanos	3,408	-			
Divisas por entregar	32,879	4,727			
Dólares americanos	32,879	4,727			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	4,184,815	3,629,293			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	305,744,515	279,554,395			
Contratos Adelantados sobre Renta Fija (Bonos)	4,251,707	5,440,355			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	5,452,402	16,482,526			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	13,843,148	1,455,867			
Contratos Adelantados sobre Euros	-	1,412,079			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	1,350,739	268,191			
Contratos Futuros sobre Renta Fija (Tasas)	21,476,654	39,147,590			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Extranjera	895,476	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	79,472,748	63,519,776			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	34,519,148	16,392,383			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	4,682,066	4,558,218			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	91,396,675	88,454,227			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	48,207,316	42,226,747			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	196,436	196,436			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	289,770,268	245,795,844			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	-	907,163			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	18,540,170	12,069,823			
Contratos Adelantados sobre Euros	1,388,691	4,601,191			
Contratos Adelantados sobre Yenes	-	2,431,096			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	2,295,924	269,187			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	8,823,347	9,896,053			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	84,991,120	82,373,153			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	47,070,624	40,499,775			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	9,137,918	8,756,959			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	764,665	850,009			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	81,245,949	65,553,617			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	35,511,860	17,587,818			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$ 13,078,877	\$ 9,462,597
Un valor de los activos netos de:	\$ 150,027,278	\$ 132,135,854

El precio de la acción de:

\$ 9.508617 \$ 8.886481

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 3, 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 SEPTIEMBRE DE 2016 Y 2015

(Cifras en miles de pesos)

	2016	2015
Ingresos por la venta de Valores	46,838,178	35,076,794
Intereses, dividendos, premios y derechos	5,541,321	5,002,840
Resultado cambiario / Otros productos	190,973	680,279
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	(4,732,761)	(4,639,835)
INGRESOS NETOS	47,837,711	36,120,078
Costo de ventas de valores	44,488,226	32,948,751
Gastos generales	19,861	18,942
Comisiones sobre saldos	1,111,423	1,099,578
Intereses sobre inversiones en valores a entregar	82,358	70,140
EGRESOS NETOS	45,701,868	34,137,411
UTILIDAD DE OPERACIÓN	2,135,843	1,982,667
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	4,584,949	(4,824,756)
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	6,720,792	(2,842,089)

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 11 de agosto de 2016, fueron aprobados los Estados Financieros al 30 de junio de 2016 y 2015, asimismo, los presentes Estados Financieros al 30 de septiembre de 2016 y 2015 serán aprobados en la Sesión del Consejo de Administración que se llevará a cabo el próximo 6 de diciembre de 2016.