

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 JUNIO DE 2018 Y 2017

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2018	2017	PASIVO	2018	2017
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	10	10	Divisas por entregar	99,356	248,027
Bancos monedas extranjeras	74,174	503,229	Acreedores	610,623	475,325
Divisas por recibir		216,751	Provisiones para gastos	19,532	17,154
	74,184	719,990	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	7,530,051	7,130,187
INVERSIONES			TOTAL PASIVO	8,259,562	7,870,693
Inversión en valores de renta variable	19,047,943	17,121,211			
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	2,351,722	2,388,115			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	62,262,227	48,700,195			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	3,741,508	4,297,800			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	38,446,906	47,931,187			
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(1,900,841)	(581,502)			
Inversiones tercerizadas	3,488,726	2,439,637			
Plus (Minus) valía en Inversiones tercerizadas	578,145	3,291			
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	9,059,058	9,063,947			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	752,383	579,834			
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	2,617,997	1,926,245			
Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	69,419	70,255			
Inversión en FIBRAS	6,124,238	5,170,097			
Plus (Minus) valía en Inversion en FIBRAS	(980,751)	(197,572)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	61,484	254,846			
Inversión en valores extranjeros de deuda	572,141	2,592,411			
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	29,345	(65,711)			
Inversión en títulos Fiduciarios	8,835,814	6,865,322			
Plus (minus) valía en Títulos Fiduciarios	2,380,457	1,687,680			
Inversión en instrumentos de deuda por reporto	4,351,208	2,179,581			
Plus (Minus) valía de valores por reporto	873	3,173			
Valores Prestados	4,111,000	2,313,499			
Plus (Minus) valía de valores prestados	(36,603)	72,403			
	165,964,399	154,815,944			
DEUDORES DIVERSOS			CAPITAL CONTABLE	2018	2017
Liquidadora	799,387	112,535			
Dividendos o derechos por cobrar	112,871	1,925			
Intereses devengados sobre valores	904,055	753,895			
Reportos	(851)	(3,132)			
Premios por cobrar por préstamo de valores	342	58			
Intereses devengados por instrumentos recibidos en reporto	3,789	16,357			
Intereses devengados sobre valores prestados	41,205	30,816			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	5,427,842	7,104,549			
	7,288,640	8,017,003			
TOTAL ACTIVO	173,327,223	163,552,937	CAPITAL		
			CAPITAL CONTRIBUIDO	98,963,708	98,152,832
			Capital social pagado	81,036,496	80,701,892
			Prima en venta de acciones	17,927,212	17,450,940
			CAPITAL GANADO	59,119,170	49,274,819
			Resultados de ejercicios anteriores	54,134,985	42,920,345
			Resultados del ejercicio	4,984,185	6,354,474
			OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
			PLUS (MINUS) VALÍAS	6,984,783	8,254,593
			TOTAL CAPITAL CONTABLE	165,067,661	155,682,244
			TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	173,327,223	163,552,937

CUENTAS DE ORDEN	2018	2017	CUENTAS DE ORDEN	2018	2017
Valores entregados en custodia	156,744,238	149,992,441	Capital social autorizado	126,259,200	126,259,200
Valores entregados en custodia por reporto	4,355,018	2,195,979	Acciones emitidas	25,000,019,801	25,000,019,801
Valores prestados	4,074,397	2,385,902	Acciones en circulación, posición propia	118,251,649	117,273,257
Garantías recibidas por Valores Prestados	4,347,982	2,546,862	Acciones de Siefores, posición de terceros	2	2
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	119,761	914,271	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	15,927,422,725	15,862,147,535
Bancos divisas en moneda extranjera	126,129	114,630			
Dólares americanos	1,419	7,178			
Euros	1,056	17,414			
Yenes	123,654	90,038			
Divisas por recibir		12,000			
Dólares americanos		12,000			
Divisas por entregar	5,046	13,732			
Dólares americanos	5,046	13,732			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	4,115,771	4,066,866			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	326,692,868	369,006,868			
Contratos Adelantados sobre Renta Fija (Bonos)	44,011				
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	16,931,318	11,696,459			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	24,415,017	27,461,820			
Contratos Adelantados sobre Euros	1,578,773	1,536,464			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	771,849				
Contratos Futuros sobre Renta Fija (Bonos)	44,763				
Contratos Futuros sobre Renta Fija (Tasas)	148,903	8,223,453			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	401,975				
Contratos Futuros sobre Renta Variable Extranjera	509,777	256,042			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano		313,500			
Contratos de Opciones sobre renta variable Nacional	3,526				
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	104,703,351	106,098,996			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	24,305,461	37,565,152			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	4,553,155	4,459,135			
Contratos de Swaps sobre Tasa fija en Euros	1,941,736				
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	115,732,428	115,906,389			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	27,655,040	52,384,058			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	2,951,785	3,105,400			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	305,958,535	363,213,141			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	1,468,001				
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	20,264,216	25,563,494			
Contratos Adelantados sobre Euros	740,289	5,441,241			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	774,940	1,213,201			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional		445,226			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	696,212	10,951,055			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	109,237,815	110,021,325			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	29,729,024	52,319,306			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	8,052,898	8,707,682			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	3,973,635	3,927,865			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	103,044,940	106,064,881			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	26,034,829	38,557,865			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	1,941,736				

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$	6,984,783	\$	8,254,593
Un valor de los activos netos de:	\$	165,067,661	\$	155,682,244
El precio de la acción de:	\$	10.287362	\$	9.742671

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 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 JUNIO DE 2018 Y 2017

(Cifras en miles de pesos)

	2018	2017
Ingresos por la venta de Valores	19,637,801	37,215,440
Intereses, dividendos, premios y derechos	4,719,877	4,063,386
Resultado cambiario / Otros productos	(74,169)	(106,272)
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	1,257,760	2,533,266
INGRESOS NETOS	25,541,269	43,705,820
Costo de ventas de valores	19,521,901	36,344,535
Gastos generales	58,272	44,047
Comisiones sobre saldos	814,078	767,744
Comisiones por servicios de tercerización	10,265	3,915
Intereses sobre inversiones en valores a entregar	152,568	191,105
EGRESOS NETOS	20,557,084	37,351,346
UTILIDAD DE OPERACIÓN	4,984,185	6,354,474
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(1,080,991)	2,745,222
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	3,903,194	9,099,696

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 23 de mayo de 2018, fueron aprobados los Estados Financieros al 31 de Marzo de 2018, asimismo, los presentes Estados Financieros al 30 de junio de 2018 serán aprobados en la Sesión del Consejo de Administración que se llevará a cabo el próximo 30 de agosto de 2018.