

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 2018 Y 2017

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2018	2017	PASIVO	2018	2017
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	10	10	Divisas por entregar		217,756
Bancos monedas extranjeras	183,156	488,178	Acreedores	159	372,996
	183,166	488,188	Provisiones para gastos	19,835	19,446
			Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	7,624,989	5,486,849
INVERSIONES			TOTAL PASIVO	7,644,983	6,097,047
Inversión en valores de renta variable	20,944,607	14,949,392			
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	1,994,038	2,919,262			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	65,004,133	52,826,518			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	4,995,970	4,682,850			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	37,178,642	47,356,621			
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(1,740,638)	(723,886)			
Inversiones tercerizadas	3,488,726	2,439,637			
Plus (Minus) valía en Inversiones tercerizadas	573,734	136,042			
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	9,217,284	10,088,772			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	233,539	777,508			
Instrumentos otorgados en garantía por Operaciones Derivadas	2,740,334	1,488,347			
Plus Minus valía en Instrumentos otorgados en garantía por Operaciones Derivadas	83,057	67,112			
Inversión en FIBRAS	6,133,113	5,383,580			
Plus (Minus) valía en Inversion en FIBRAS	(1,263,196)	(495,748)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	24,043	271,033			
Inversión en valores extranjeros de deuda	572,141	2,592,411			
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	27,999	(57,124)			
Inversión en títulos Fiduciarios	9,719,402	7,148,108			
Plus (minus) valía en Títulos Fiduciarios	2,479,450	1,738,489			
Inversión en instrumentos de deuda por reporto	2,272,204	1,873,557			
Plus (Minus) valía de valores por reporto	5,923	2,643			
Valores Prestados	4,304,730	2,163,154			
Plus (Minus) valía de valores prestados	101,484	116,972			
	169,090,719	157,745,250			
DEUDORES DIVERSOS			CAPITAL CONTABLE	2018	2017
Liquidadora	27,666	424,963			
Dividendos o derechos por cobrar	95,216	87,495			
Intereses devengados sobre valores	1,645,462	1,693,148			
Reportos	(5,922)	(2,653)			
Premios por cobrar por préstamo de valores	213	58			
Intereses devengados por instrumentos recibidos en reporto	12,372	8,612			
Intereses devengados sobre valores prestados	61,527	21,399			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	6,065,219	6,685,850			
	7,901,753	8,918,872	CAPITAL		
			CAPITAL CONTRIBUIDO	101,034,813	99,752,925
			Capital social pagado	82,044,550	81,521,277
			Prima en venta de acciones	18,990,263	18,231,648
			CAPITAL GANADO	61,010,406	52,140,861
			Resultados de ejercicios anteriores	54,134,984	42,920,345
			Resultados del ejercicio	6,875,422	9,220,516
			OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
			PLUS (MINUS) VALÍAS	7,485,436	9,161,477
			TOTAL CAPITAL CONTABLE	169,530,655	161,055,263

TOTAL ACTIVO	177,175,638	167,152,310
--------------	-------------	-------------

TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	177,175,638	167,152,310
--------------------------	-------------	-------------

CUENTAS DE ORDEN	2018	2017	CUENTAS DE ORDEN	2018	2017
Valores entregados en custodia	161,746,735	153,317,890	Capital social autorizado	126,259,200	126,259,200
Valores entregados en custodia por reporte	2,284,577	1,882,159	Acciones emitidas	25,000,019,801	25,000,019,801
Valores prestados	4,406,213	2,280,126	Acciones en circulación, posición propia	120,461,375	118,489,513
Garantías recibidas por valores prestados	4,742,278	2,436,028	Acciones de Siefres, posición de terceros	2	2
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	453,148	1,040,462	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	16,124,813,211	16,023,174,227
Bancos divisas en moneda extranjera	76,472	289,124			
Dólares americanos	8,560	21,479			
Euros	542	2,580			
Yenes	67,370	265,065			
Divisas por entregar		11,992			
Dólares americanos		11,992			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	7,290,313	4,309,176			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	329,258,521	378,374,669			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	15,811,407	15,015,531			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	29,597,970	29,196,206			
Contratos Adelantados sobre Euros	3,003,623	646,093			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	771,849				
Contratos de Futuros sobre Renta Fija (Tasas)		3,805,719			
Contratos de Futuros sobre Renta Variable Extranjera	407,864	262,625			
Contratos de Opciones sobre Renta Variable Nacional	3,526	3,526			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	100,765,762	105,290,255			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	31,950,144	46,347,094			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	4,299,396	4,459,135			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	1,941,736				
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	107,450,390	113,927,678			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	30,303,069	56,315,407			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	2,951,785	3,105,400			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	310,211,914	364,718,615			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	3,197,565				
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	23,309,559	19,024,579			
Contratos Adelantados sobre Euros	1,042,215	4,123,298			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	774,940	1,187,851			
Contratos de Futuros sobre Renta Variable Nacional	436,421	226,294			
Contratos de Futuros sobre Dólar Americano	1,611,611	10,629,396			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	100,955,779	108,042,614			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	33,553,699	57,405,173			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	7,082,942	8,707,682			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	3,717,620	3,927,865			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	98,908,316	104,104,056			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	33,679,511	47,339,807			
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:	\$ 7,485,436	\$ 9,161,477
Un valor de los activos netos de:	\$ 169,530,655	\$ 161,055,263
El precio de la acción de:	\$ 10.435690	\$ 9.977612

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 SEPTIEMBRE DE 2018 Y 2017

(Cifras en miles de pesos)

	2018	2017
Ingresos por la venta de Valores	31,980,983	53,279,285
Intereses, dividendos, premios y derechos	6,878,111	6,052,995
Resultado cambiario / Otros productos	(266,651)	(594,766)
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	2,258,073	3,618,083
INGRESOS NETOS	40,850,516	62,355,597
Costo de ventas de valores	32,421,734	51,660,247
Gastos generales	95,875	68,774
Comisiones sobre saldos	1,238,837	1,172,871
Comisiones por servicios de tercerización	15,630	7,119
Intereses sobre inversiones en valores a entregar	203,018	226,070
EGRESOS NETOS	33,975,094	53,135,081
UTILIDAD DE OPERACIÓN	6,875,422	9,220,516
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(580,339)	3,652,105
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	6,295,083	12,872,621

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.

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS:

En la Sesión del Consejo de Administración con fecha 30 de agosto de 2018, fueron aprobados los Estados Financieros al 30 de junio de 2018, asimismo, los presentes Estados Financieros al 30 de septiembre de 2018 serán aprobados en la Sesión del Consejo de Administración que se llevará a cabo el próximo 29 de noviembre de 2018.