

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

**SIFORE 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 MARZO DE 2016 Y 2015

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2016	2015	PASIVO	2016	2015
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	10	10	Acreedores	-	72,250
Bancos monedas extranjeras	1,224,278	362,791	Provisiones para gastos	4,391	4,184
Divisas por recibir	-	2,812	Divisas por entregar	54,334	-
	1,224,288	365,613	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	6,834,259	5,006,565
INVERSIONES			TOTAL PASIVO	6,892,984	5,082,999
Inversión en valores de renta variable	15,591,852	14,521,125			
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	3,958,977	4,757,467			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	39,797,607	36,127,675			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	3,291,423	3,646,359			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	53,633,165	43,506,112			
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	1,020,769	2,070,720			
Depósito Traspaso Banxico	243,546	255,798			
Plus (Minus) valía en inversión en el Depósito Traspaso Banxico	2,828	1,291			
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	2,698,185	2,228,415			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	709,034	522,481			
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	95,011	-			
Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	2,048	-			
Inversión en FIBRAS	3,731,442	2,464,633			
Plus (Minus) valía en Inversión en FIBRAS	344,411	324,685			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	601,819	998,020			
Inversión en valores extranjeros de deuda	1,349,570	1,986,825			
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	120,641	260,316			
Inversión en títulos Fiduciarios	4,686,738	3,852,602			
Plus (minus) valía en Títulos Fiduciarios	1,141,303	1,116,516			
Inversión en instrumentos de deuda por reporto	2,633,595	5,199,196			
Plus (Minus) valía de valores por reporto	3,469	(2,914)			
Valores Prestados	-	108,096			
Plus (Minus) valía de valores prestados	-	(1,325)			
	135,657,433	123,944,093			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	553	83,490			
Dividendos o derechos por cobrar	13,322	14,153			
Intereses devengados sobre valores	1,603,669	1,347,950			
Reportos	(3,466)	2,608			
Premios por cobrar por préstamo de valores	-	1			
Intereses devengados por instrumentos recibidos en reporto	2,712	61,969			
Intereses devengados sobre valores prestados	-	1,560			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	5,898,440	4,427,477			
	7,515,230	5,939,208			
TOTAL ACTIVO	144,396,951	130,248,914			
			CAPITAL CONTABLE	2016	2015
			CAPITAL		
			CAPITAL CONTRIBUIDO	42,092,119	30,105,033
			Capital social pagado	15,869,704	14,402,980
			Prima en venta de acciones	26,222,415	15,702,053
			CAPITAL GANADO	84,820,414	82,362,372
			Resultados de ejercicios anteriores	85,686,989	80,426,423
			Resultados del ejercicio	(866,575)	1,935,949
			OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
			PLUS (MINUS) VALÍAS	10,591,434	12,698,510
			TOTAL CAPITAL CONTABLE	137,503,967	125,165,915
			TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	144,396,951	130,248,914

CUENTAS DE ORDEN	2016	2015	CUENTAS DE ORDEN	2016	2015
Valores entregados en custodia	132,418,551	117,643,019	Capital social autorizado	27,500,100	27,500,100
Valores entregados en custodia por reporto	2,636,310	5,260,859	Acciones emitidas	27,500,100,000	27,500,100,000
Valores prestados	-	106,771	Acciones en circulación, posición propia	118,058,766	107,930,169
Garantías recibidas por préstamo de valores	-	139,975	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	15,751,645,609	14,295,049,681
Bancos divisas en moneda extranjera	399,763	51,297			
Dólares americanos	60,849	20,518			
Euros	6,347	2,806			
Yenes	332,567	27,973			
Divisas por recibir	-	184			
Dólares americanos	-	184			
Divisas por entregar	3,152	-			
Dólares americanos	3,152	-			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	3,087,295	1,646,635			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	246,584,565	180,833,033			
Contratos Adelantados sobre Renta Fija (Bonos)	1,664,571	1,897,554			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	4,092,537	8,699,284			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	21,082,269	284,047			
Contratos Adelantados sobre Euros	538,619	1,743,670			
Contratos Adelantados sobre Yenes	142,350	274,892			
Contratos Futuros sobre Renta Fija (Tasas)	16,356,998	26,295,284			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Extranjera	360,850	-			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	1,134,555	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	50,599,507	37,603,542			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	29,087,001	13,283,223			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	3,593,482	2,905,873			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	74,217,453	56,188,516			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	43,586,955	31,529,730			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	127,418	127,418			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	234,471,252	163,448,304			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	-	887,085			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	17,720,317	-			
Contratos Adelantados sobre Euros	3,232,320	4,991,570			
Contratos Adelantados sobre Yenes	1,579,398	1,658,596			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	1,080,927	202,314			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	9,582,100	14,013,869			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	69,292,675	51,441,648			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	42,379,910	30,294,475			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	6,926,913	6,751,808			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	585,700	585,700			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	52,618,303	38,952,328			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	29,472,689	13,668,911			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$ 10,591,434	\$ 12,698,510
Un valor de los activos netos de:	\$ 137,503,967	\$ 125,165,915
El precio de la acción de:	\$ 8.664558	\$ 8.690279

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 MARZO DE 2016 Y 2015

(Cifras en miles de pesos)

	2016	2015
Ingresos por la venta de Valores	13,128,474	7,165,233
Intereses, dividendos, premios y derechos	1,673,198	1,460,156
Resultado cambiario / Otros productos	(8,315)	538,406
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	(3,199,538)	(388,903)
INGRESOS NETOS	11,593,819	8,774,892
Costo de ventas de valores	12,087,594	6,454,387
Gastos generales	6,111	5,249
Comisiones sobre saldos	346,258	334,222
Intereses sobre inversiones en valores a entregar	20,431	45,085
EGRESOS NETOS	12,460,394	6,838,943
UTILIDAD DE OPERACIÓN	(866,575)	1,935,949
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	1,349,750	(1,054,182)
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	483,175	881,767

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 4 de febrero de 2016, fueron aprobados los Estados Financieros al 31 de Diciembre de 2015 y 2014, así mismo, los presentes Estados Financieros al 31 de Marzo de 2016 y 2015 serán aprobados en la Sesión del Consejo de Administración que se llevará a cabo el próximo 3 de Junio de 2016.