

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

**SIFORE 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 31 DE MARZO DE 2016 Y 2015

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2016	2015	PASIVO	2016	2015
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	11	10	Acreedores	-	31,500
Bancos monedas extranjeras	1,240,591	434,182	Provisiones para gastos	4,415	4,474
	1,240,602	434,192	Divisas por entregar	63,098	-
INVERSIONES			Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	8,885,317	7,310,941
Inversión en valores de renta variable	15,461,039	15,685,737		-	-
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	3,545,594	4,920,087	TOTAL PASIVO	8,952,830	7,346,915
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	37,216,674	35,238,847			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	2,879,375	3,203,600	CAPITAL CONTABLE	2016	2015
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	53,847,347	49,060,989			
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	802,186	2,052,566	CAPITAL		
Depósito Traspaso Banxico	3,799	-	CAPITAL CONTRIBUIDO	89,362,471	84,032,326
Plus (Minus) valía en inversión en el Depósito Traspaso Banxico	44	-	Capital social pagado	75,943,525	73,005,336
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	2,873,106	2,497,455	Prima en venta de acciones	13,418,946	11,026,990
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	730,108	563,061		37,134,018	35,257,657
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	152,543	-	CAPITAL GANADO		
Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	2,552	-	Resultados de ejercicios anteriores	38,506,998	32,894,933
Inversión en FIBRAS	4,808,852	3,487,478	Resultados del ejercicio	(1,372,980)	2,362,724
Plus (Minus) valía en Inversión en FIBRAS	441,020	455,339			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	664,083	1,095,074	OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
Inversión en valores extranjeros de deuda	1,299,974	2,031,490	PLUS (MINUS) VALÍAS	10,044,136	13,086,952
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	113,365	264,105			
Inversión en títulos Fiduciarios	6,133,909	5,567,414	TOTAL CAPITAL CONTABLE	136,540,625	132,376,935
Plus (minus) valía en Títulos Fiduciarios	1,529,893	1,629,593			
Inversión en instrumentos de deuda por reporto	2,747,491	3,390,624			
Plus (Minus) valía de valores por reporto	5,826	1,431			
Valores Prestados	-	114,101			
Plus (Minus) valía de valores prestados	-	(1,399)			
	135,258,780	131,257,592			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	549	111,207			
Dividendos o derechos por cobrar	2,338	9,218			
Intereses devengados sobre valores	1,572,095	1,441,145			
Reportos	(5,823)	(1,509)			
Premios por cobrar por préstamo de valores	-	1			
Intereses devengados por instrumentos recibidos en reporto	2,714	24,976			
Intereses devengados sobre valores prestados	-	1,647			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	7,422,200	6,445,381			
	8,994,073	8,032,066			
TOTAL ACTIVO	145,493,455	139,723,850	TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	145,493,455	139,723,850

CUENTAS DE ORDEN	2016	2015	CUENTAS DE ORDEN	2016	2015
Valores entregados en custodia	131,841,381	126,657,761	Capital social autorizado	126,259,200	126,259,200
Valores entregados en custodia por reporto	2,750,208	3,415,522	Acciones emitidas	25,000,019,801	25,000,019,801
Valores prestados	-	112,703	Acciones en circulación, posición propia	112,956,354	112,956,354
Garantías recibidas por préstamo de valores	-	150,742	Acciones de Siefores, posición de terceros	2	2
Bancos divisas en moneda extranjera	479,171	167,627	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	14,924,281,483	14,342,503,922
Dólares americanos	58,986	24,952			
Euros	8,196	2,159			
Yenes	411,989	140,516			
Divisas por entregar	3,661	-			
Dólares americanos	3,661	-			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	3,956,130	2,364,355			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	307,631,981	258,933,919			
Contratos Adelantados sobre Renta Fija (Bonos)	6,114,001	4,781,576			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	7,828,532	14,082,502			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	21,528,891	770,426			
Contratos Adelantados sobre Euros	144,861	2,041,750			
Contratos Adelantados sobre Yenes	142,350	372,441			
Contratos Futuros sobre Renta Fija (Tasas)	30,312,122	47,983,057			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	-	983,561			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Extranjera	1,438,754	-			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	884,435	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	68,113,042	56,755,944			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	29,251,152	13,323,229			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	4,564,415	3,619,159			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	91,334,721	76,723,895			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	45,778,269	37,299,943			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	196,436	196,436			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	271,074,459	211,785,713			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	-	1,131,257			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	15,799,718	-			
Contratos Adelantados sobre Euros	3,439,064	6,200,471			
Contratos Adelantados sobre Yenes	2,395,108	2,456,931			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	1,245,116	269,752			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	8,702,832	13,528,212			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	85,063,443	70,642,821			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	44,051,298	35,536,702			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	8,928,220	8,756,959			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	850,009	850,009			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	70,153,064	57,920,601			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	30,446,587	14,491,998			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$	10,044,136	\$	13,086,952
Un valor de los activos netos de:	\$	136,540,625	\$	132,376,935
El precio de la acción de:	\$	9.080167	\$	9.157573

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 31 DE MARZO DE 2016 Y 2015

(Cifras en miles de pesos)

	2016	2015
Ingresos por la venta de Valores	19,012,070	8,537,274
Intereses, dividendos, premios y derechos	1,678,460	1,558,670
Resultado cambiario / Otros productos	103,193	493,986
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	(3,641,721)	(106,764)
INGRESOS NETOS	17,152,002	10,483,166
Costo de ventas de valores	18,158,923	7,730,174
Gastos generales	6,891	6,084
Comisiones sobre saldos	341,281	354,992
Intereses sobre inversiones en valores a entregar	17,887	29,192
EGRESOS NETOS	18,524,982	8,120,442
UTILIDAD DE OPERACIÓN	(1,372,980)	2,362,724
OTROS RESULTADOS INTEGRALES PLUS (MINUS) VALÍAS	1,550,208	(1,200,401)
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	177,228	1,162,323

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.