

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO
SIEFORE SURA BÁSICA 4, 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 2015 Y 2014

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2015	2014	PASIVO	2015	2014
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	1,235	10	Divisas por entregar	107,782	34,151
Bancos monedas extranjeras	80,203	393,470	Acreedores	162,069	1,604,467
Divisas por recibir	416		Provisiones para gastos	2,922	3,131
	81,854	393,480	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	8,685,293	7,848,825
RESERVADOS					
Bancos Moneda Nal., Depósitos reserv. al pago compromisos futuros en pesos		1,113,406			
		1,113,406			
INVERSIONES			TOTAL PASIVO	8,958,066	9,490,574
Inversión en valores de renta variable	15,236,077	15,842,764			
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	2,905,804	3,236,133			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	23,775,378	22,776,304			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	886,058	1,413,112			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	36,274,756	33,372,879			
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	165,189	626,356			
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	1,835,848	2,365,635			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	526,602	244,483			
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	32,055				
Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	285				
Inversión en FIBRAS	3,140,960	2,190,492			
Plus (Minus) valía en Inversión en FIBRAS	(57,516)	523,429			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	623,096	1,074,831			
Inversión en valores extranjeros de deuda	1,198,696	1,356,157			
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	146,063	177,333			
Inversión en títulos Fiduciarios	3,890,901	3,836,604			
Plus (minus) valía en Títulos Fiduciarios	1,076,740	1,066,932			
Inversión en instrumentos de deuda por reporto	2,122,512	1,677,061			
Plus (Minus) valía de valores por reporto	544	(205)			
Valores Prestados	568,283	375,299			
Plus (Minus) valía de valores prestados	(13,876)	568			
	94,334,455	92,156,167			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	117,546	167			
Dividendos o derechos por cobrar	11,500	8,625			
Intereses devengados sobre valores	1,045,311	965,348			
Reportos	(429)	208			
Premios por cobrar por préstamo de valores	29	4			
Intereses devengados por instrumentos recibidos en reporto	1,387	898			
Intereses devengados sobre valores prestados	4,754	2,485			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	6,890,638	7,666,022			
	8,070,736	8,643,757			
TOTAL ACTIVO	102,487,045	102,306,810	TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	102,487,045	102,306,810

CUENTAS DE ORDEN	2015	2014	CUENTAS DE ORDEN	2015	2014
Valores entregados en custodia	91,033,895	89,028,614	Capital social autorizado	126,259,200	126,259,200
Valores entregados en custodia por reporto	2,124,015	1,677,962	Acciones emitidas	25,000,019,801	25,000,019,801
Valores prestados	554,407	375,867	Acciones en circulación, posición propia	79,430,494	82,135,006
Garantías recibidas por préstamo de valores	598,100	401,893	Acciones de Siefores, posición de terceros	2	2
Bancos divisas en moneda extranjera	4,744	789,540	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	9,904,788,379	9,972,823,121
Dólares americanos	4,733	18,333			
Euros	11	3,130			
Yenes		768,077			
Divisas por recibir	25				
Dólares americanos	25				
Divisas por entregar	6,376	2,542			
Dólares americanos	6,376	2,542			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	2,536,796	1,782,922			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	307,468,987	306,452,197			
Contratos Adelantados sobre Renta Fija (Bonos)	3,743,422	4,157,912			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	16,722,636	11,020,126			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	1,149,600	2,072,190			
Contratos Adelantados sobre Euros	1,003,309				
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	275,638				
Contratos Futuros sobre Renta Fija (Tasas)	58,697,528	84,715,794			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	726,984	1,605,602			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	72,222,000	68,879,729			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	14,848,781	14,168,173			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	6,780,280	5,018,628			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	91,997,063	77,417,003			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	39,094,692	37,189,986			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	207,054	207,054			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	252,246,838	223,367,174			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	852,635				
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	10,932,107	521,547			
Contratos Adelantados sobre Euros	4,452,797	5,781,014			
Contratos Adelantados sobre Yenes	2,639,747	2,652,643			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	276,665				
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	8,151,349	11,727,646			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	86,144,045	71,020,685			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	36,660,673	34,848,658			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	9,991,872	10,541,435			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	826,655	826,655			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	74,748,504	69,601,033			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	16,569,789	15,845,858			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$	5,635,349	\$	7,288,346
Un valor de los activos netos de:	\$	93,528,979	\$	92,816,236
El precio de la acción de:	\$	9.367681	\$	9.230892

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 4, 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 2015 Y 2014
(Cifras en miles de pesos)

	2015	2014
Ingresos por la venta de Valores	25,216,609	21,855,513
Intereses, dividendos, premios y derechos	3,447,293	3,296,374
Resultado cambiario / Otros productos	649,299	162,693
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	(4,178,571)	1,286,658
INGRESOS NETOS	25,134,630	26,601,238
Costo de ventas de valores	23,925,113	21,232,186
Gastos generales	16,276	21,308
Comisiones sobre saldos	768,150	732,146
Intereses sobre inversiones en valores a entregar	67,540	119,920
EGRESOS NETOS	24,777,079	22,105,560
UTILIDAD DE OPERACIÓN	357,551	4,495,678
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	5,635,349	7,288,346
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	5,992,900	11,784,024

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 Agosto de 2015, fueron aprobados los Estados Financieros al 30 de Junio 2015 y 2014, así mismo, los presentes Estados Financieros al 30 de Septiembre de 2015 y 2014 serán aprobados en la sesión de Consejo de Administración que se llevara a cabo el próximo 8 de Diciembre de 2015.