

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 31 DE MARZO DE 2019 Y 2018

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2019	2018	PASIVO	2019	2018
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	10	10	Divisas por entregar	988,273	
Bancos monedas extranjeras	1,016,129	156,204	Acreedores	1,060,210	267,157
Divisas por recibir	32,462	1,276	Provisiones para gastos	19,397	27,498
	1,048,601	157,490	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	5,659,306	6,770,837
INVERSIONES			TOTAL PASIVO	7,727,186	7,065,492
Inversión en valores de renta variable	19,183,406	16,978,469			
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	881,592	1,920,814			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	58,943,351	58,595,895			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	5,122,796	4,157,757			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	40,381,554	38,645,190			
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(1,419,559)	(1,584,131)			
Inversiones tercerizadas	3,488,726	3,488,726			
Plus (Minus) valía en Inversiones tercerizadas	686,218	194,993			
Depósito Traspaso Banxico	6,817				
Plus (Minus) valía en inversión en el Depósito Traspaso Banxico	36				
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	6,454,146	8,897,682			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	564,578	392,396			
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	2,930,699	2,702,228			
Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	(23,106)	78,656			
Inversión en FIBRAS	6,466,068	6,134,289			
Plus (Minus) valía en Inversion en FIBRAS	(1,178,764)	(966,118)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	26,254	66,176			
Inversión en valores extranjeros de deuda	411,028	572,141			
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	(15,386)	36,803			
Inversión en títulos Fiduciarios	10,533,931	8,123,756			
Plus (minus) valía en Títulos Fiduciarios	2,757,955	2,488,724			
Inversión en instrumentos de deuda por reporto	6,319,516	4,692,893			
Plus (Minus) valía de valores por reporto	22,564	3,329			
Valores Prestados	6,854,909	4,043,289			
Plus (Minus) valía de valores prestados	236,023	16,389			
	169,635,352	159,680,346			
DEUDORES DIVERSOS			CAPITAL CONTABLE	2019	2018
Liquidadora	1,151,797	459,031			
Dividendos o derechos por cobrar	9,963	47,656			
Intereses devengados sobre valores	1,591,940	1,615,198			
Reportos	(22,575)	(3,110)			
Premios por cobrar por préstamo de valores	334	245			
Intereses devengados por instrumentos recibidos en reporto	18,532	22,198			
Intereses devengados sobre valores prestados	90,161	70,492			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	3,608,728	5,015,759			
	6,448,880	7,227,469			
TOTAL ACTIVO	177,132,833	167,065,305	CAPITAL		
			CAPITAL CONTRIBUIDO	98,232,608	97,312,407
			Capital social pagado	80,597,194	80,219,904
			Prima en venta de acciones	17,635,414	17,092,503
			CAPITAL GANADO	63,560,655	55,951,124
			Resultados de ejercicios anteriores	59,908,017	54,134,985
			Resultados del ejercicio	3,652,638	1,816,139
			OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
			PLUS (MINUS) VALÍAS	7,612,384	6,736,282
			TOTAL CAPITAL CONTABLE	169,405,647	159,999,813
			TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	177,132,833	167,065,305

CUENTAS DE ORDEN	2019	2018	CUENTAS DE ORDEN	2019	2018
Valores entregados en custodia	155,437,485	149,934,470	Capital social autorizado	126,259,200	126,259,200
Valores entregados en custodia por reporto	6,338,038	4,715,310	Acciones emitidas	25,000,019,801	25,000,019,801
Valores prestados	7,090,932	4,059,678	Acciones en circulación, posición propia	118,607,423	117,564,831
Garantías recibidas por valores prestados	7,616,403	4,368,355	Acciones de Siefors, posición de terceros	2	2
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	394,680	115,568	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	15,840,082,586	15,766,419,777
Bancos divisas en moneda extranjera	75,096	274,707			
Dólares americanos	51,633	5,922			
Euros	533	92			
Yenes	22,930	268,693			
Divisas por recibir	1,675	70			
Dólares americanos	1,675	70			
Divisas por entregar	51,000				
Dólares americanos	51,000				
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	9,020,318	4,989,628			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	301,881,096	320,418,814			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	14,413,890	16,072,073			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	19,875,437	19,132,589			
Contratos Adelantados sobre Euros	3,034,159	783,336			
Contratos de Futuros sobre Renta Fija (Tasas)		595,613			
Contratos de Futuros sobre Renta Variable Extranjera	405,143	461,627			
Contratos de Opciones sobre Renta Variable Nacional	2,803	3,526			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	93,837,789	103,461,484			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	35,063,329	23,593,745			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	3,283,547	4,553,155			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	1,941,736				
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	96,987,368	118,897,368			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	30,084,110	29,912,513			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	2,951,785	2,951,785			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	283,218,887	298,972,386			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	3,123,522	390,200			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	14,657,108	11,715,410			
Contratos Adelantados sobre Euros	434,752	740,289			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas		774,940			
Contratos de Futuros de Renta Variable Nacional	295,223	1,131,765			
Contratos de Futuros sobre Dólar Americano	369,824	696,212			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	92,220,372	112,369,856			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	33,582,205	31,425,941			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	5,142,344	8,628,273			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	3,694,375	3,770,247			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	91,755,831	102,006,140			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	36,001,595	25,323,113			
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:	\$ 7,612,384	\$ 6,736,282
Un valor de los activos netos de:	\$ 169,405,647	\$ 159,999,813
El precio de la acción de:	\$ 10.615260	\$ 10.073027

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 31 DE MARZO DE 2019 Y 2018

(Cifras en miles de pesos)

	2019	2018
Ingresos por la venta de Valores	10,345,694	13,695,472
Intereses, dividendos, premios y derechos	2,052,258	2,320,362
Resultado cambiario / Otros productos	(35,541)	(135,228)
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	1,853,441	(37,026)
INGRESOS NETOS	14,215,852	15,843,580
Costo de ventas de valores	10,044,345	13,514,472
Gastos generales	49,807	26,565
Comisiones sobre saldos	393,201	399,181
Comisiones por servicios de tercerización	5,212	4,970
Intereses sobre inversiones en valores a entregar	70,649	82,253
EGRESOS NETOS	10,563,214	14,027,441
UTILIDAD DE OPERACIÓN	3,652,638	1,816,139
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	5,585,927	(1,329,492)
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	9,238,565	486,647

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 13 de Febrero de 2019, fueron aprobados los Estados Financieros al 31 de Diciembre de 2018, asimismo, los presentes Estados Financieros al 31 de Marzo de 2019 serán aprobados en la Sesión del Consejo de Administración que se llevará a cabo el próximo 28 de mayo de 2019.