

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

ESTADO DE SITUACIÓN FINANCIERA AL 30 DE SEPTIEMBRE DE 2017 Y 2016

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2017	2016	PASIVO	2017	2016
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	10	10	Divisas por entregar	428,360	502,803
Bancos monedas extranjeras	674,814	1,323,742	Acreedores	379,089	1,984,255
Divisas por recibir		1,726,747	Provisiones para gastos	19,442	13,030
	674,824	3,050,499	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	4,205,520	5,723,030
RESERVADOS					
Depósitos reservados al pago compromisos futuros en divisas		52,436			
	-	52,436			
INVERSIONES					
Inversión en valores de renta variable	16,099,954	15,917,993	TOTAL PASIVO	5,032,411	8,223,118
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	3,390,870	5,521,850			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	57,157,799	42,882,980			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	5,186,369	4,383,960			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	50,277,108	53,975,841			
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(734,444)	884,006	CAPITAL CONTABLE	2017	2016
Inversiones tercerizadas	2,214,871				
Plus (Minus) valía en Inversiones tercerizadas	123,417				
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	10,507,029	5,183,169	CAPITAL		
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	744,234	1,308,203			
Instrumentos otorgados en garantía por Operaciones Derivadas	1,271,923	-	CAPITAL CONTRIBUIDO	57,186,586	45,416,042
Plus Minus valía en Instrumentos otorgados en garantía por Operaciones Derivadas	59,881	-	Capital social pagado	17,599,516	16,240,761
Inversión en FIBRAS	4,806,915	3,892,473	Prima en venta de acciones	39,587,070	29,175,281
Plus (Minus) valía en Inversion en FIBRAS	(426,667)	(23,479)	CAPITAL GANADO	100,188,327	88,332,559
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	24,420	810,648	Resultados de ejercicios anteriores	89,628,668	85,686,989
Inversión en valores extranjeros de deuda	2,090,655	1,201,990	Resultados del ejercicio	10,559,659	2,645,570
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	10,900	109,648	OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
Inversión en títulos Fiduciarios	5,718,247	4,875,366	PLUS (MINUS) VALÍAS	9,783,620	13,489,056
Plus (minus) valía en Títulos Fiduciarios	1,324,673	1,304,869			
Inversión en instrumentos de deuda por reporto	1,276,726	2,671,868	TOTAL CAPITAL CONTABLE	167,158,533	147,237,657
Plus (Minus) valía de valores por reporto	2,436	3,087			
Valores Prestados	2,215,847	-			
Plus (Minus) valía de valores prestados	104,388	-			
	163,447,551	144,904,472			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	629,798	368,734			
Dividendos o derechos por cobrar	67,966	14,745			
Intereses devengados sobre valores	1,802,394	1,705,265			
Reportos	(2,439)	(2,985)			
Premios por cobrar por préstamo de valores	57	-			
Intereses devengados por instrumentos recibidos en reporto	6,275	7,986			
Intereses devengados sobre valores prestados	19,934	-			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	5,544,584	5,359,623			

	8,068,569	7,453,368			
TOTAL ACTIVO	172,190,944	155,460,775	TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	172,190,944	155,460,775

CUENTAS DE ORDEN	2017	2016	CUENTAS DE ORDEN	2017	2016
Valores entregados en custodia	159,823,734	141,418,870	Capital social autorizado	27,500,100	27,500,100
Valores entregados en custodia por reporto	1,282,998	2,679,955	Acciones emitidas	27,500,100,000	27,500,100,000
Valores prestados	2,320,235	-	Acciones en circulación, posición propia	129,554,252	119,168,992
Garantías recibidas por valores prestados	2,476,321	-	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	17,469,961,401	16,121,591,903
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	900,926	175,752			
Bancos divisas en moneda extranjera	339,344	272,702			
Dólares americanos	32,878	45,196			
Euros	1,330	18,739			
Yenes	305,136	208,767			
Divisas por recibir	-	89,111			
Dólares americanos	-	89,111			
Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en moneda extranjera	-	2,706			
Dólares americanos	-	2,706			
Divisas por entregar	23,589	25,948			
Dólares americanos	23,589	25,948			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	3,780,384	3,275,886			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	342,670,518	248,015,188			
Contratos Adelantados sobre Renta Fija (Bonos)		1,822,160			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	10,328,848	4,249,227			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	31,376,716	11,573,225			
Contratos Adelantados sobre Euros	675,576	-			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas		1,173,386			
Contratos Futuros sobre Renta Fija (Tasas)	1,449,568	11,387,854			
Contratos Opcionales sobre Renta Variable Nacional	3,153				
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	87,451,733	58,855,527			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	46,962,105	34,190,926			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	3,574,943	3,822,545			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	101,020,649	74,676,870			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	56,626,496	46,136,050			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	3,200,731	127,418			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	335,361,694	249,678,343			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera		1,772,337			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	20,383,670	17,666,683			
Contratos Adelantados sobre Euros	4,065,055	1,110,783			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	933,772	1,942,834			
Contratos Futuros sobre Renta Variable nacional	212,625				
Contratos Futuros sobre Renta Variable Extranjera		184,723			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	10,860,414	9,136,696			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	96,064,968	69,588,654			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	58,159,253	45,414,716			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	7,098,472	7,145,700			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	4,043,401	518,250			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	86,325,384	60,753,466			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	47,214,680	34,443,501			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$ 9,783,620	\$ 13,489,056
Un valor de los activos netos de:	\$ 167,158,533	\$ 147,237,657
El precio de la acción de:	\$ 9.497905	\$ 9.065933

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 30 DE SEPTIEMBRE DE 2017 Y 2016

(Cifras en miles de pesos)

	2017	2016
Ingresos por la venta de Valores	55,124,506	35,085,929
Intereses, dividendos, premios y derechos	6,249,511	5,464,618
Resultado cambiario / Otros productos	(676,097)	(56,681)
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	3,200,225	(4,208,451)
INGRESOS NETOS	63,898,145	36,285,415
Costo de ventas de valores	51,791,671	32,419,312
Gastos generales	72,577	18,088
Comisiones sobre saldos	1,235,107	1,113,224
Comisiones por servicios de tercerización	6,465	
Intereses sobre inversiones en valores a entregar	232,666	89,221
EGRESOS NETOS	53,338,486	33,639,845
UTILIDAD DE OPERACIÓN	10,559,659	2,645,570
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	2,273,022	4,247,372
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	12,832,681	6,892,942

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.

NOTA A LOS ESTADOS FINANCIEROS:

En la Sesión del Consejo de Administración con fecha 28 de agosto de 2017, fueron aprobados los Estados Financieros al 30 de junio de 2017, asimismo, los presentes Estados Financieros al 30 de septiembre de 2017 y 2016 serán aprobados en la Sesión del Consejo de Administración que se llevará a cabo el próximo 7 de noviembre de 2017.