

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 DICIEMBRE DE 2018 Y 2017

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2018	2017	PASIVO	2018	2017
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	10	10	Acreedores	185,274	68,306
Bancos monedas extranjeras	773,780	580,286	Provisiones para gastos	14,378	21,649
Divisas por recibir	5,610		Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	8,135,247	7,714,634
	779,400	580,296	TOTAL PASIVO	8,334,899	7,804,589
INVERSIONES			CAPITAL CONTABLE		
Inversión en valores de renta variable	21,688,149	14,246,123	CAPITAL		
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	(371,336)	3,395,696	CAPITAL CONTRIBUIDO	96,178,006	95,656,101
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	61,754,180	55,405,957	Capital social pagado	79,595,674	79,391,656
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	4,264,429	4,043,353	Prima en venta de acciones	16,582,332	16,264,445
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	36,871,732	46,114,494	CAPITAL GANADO	59,908,017	54,134,986
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(2,638,001)	(2,652,632)	Resultados de ejercicios anteriores	54,134,985	42,920,346
Inversiones tercerizadas	3,488,726	2,439,637	Resultados del ejercicio	5,773,032	11,214,640
Plus (Minus) valía en Inversiones tercerizadas	244,868	549,798	OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
Depósito Traspaso Banxico	6,789		PLUS (MINUS) VALÍAS	2,026,458	8,065,774
Plus (Minus) valía en inversión en el Depósito Traspaso Banxico	2		TOTAL CAPITAL CONTABLE	158,112,481	157,856,861
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	7,789,424	9,434,571			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	291,799	1,555,949			
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	5,158,721	2,050,803			
Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	(106,479)	75,394			
Inversión en FIBRAS	6,133,113	5,639,263			
Plus (Minus) valía en Inversion en FIBRAS	(1,878,207)	(813,476)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	27,368	351,138			
Inversión en valores extranjeros de deuda	549,028	831,465			
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	13,269	74,627			
Inversión en títulos Fiduciarios	10,033,541	7,910,814			
Plus (minus) valía en Títulos Fiduciarios	2,218,322	1,866,424			
Inversión en instrumentos de deuda por reporto	1,523,938	4,217,690			
Plus (Minus) valía de valores por reporto	2,534	9,620			
Valores Prestados	2,816,822	728,661			
Plus (Minus) valía de valores prestados	(12,208)	(29,359)			
	159,870,523	157,446,010			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	172,652	722			
Dividendos o derechos por cobrar	380	120,435			
Intereses devengados sobre valores	894,347	951,806			
Reportos	(2,546)	(9,681)			
Premios por cobrar por préstamo de valores	111	33			
Intereses devengados por instrumentos recibidos en reporto	4,623	11,088			
Intereses devengados sobre valores prestados	34,684	3,132			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	4,693,206	6,557,609			
	5,797,457	7,635,144			
TOTAL ACTIVO	166,447,380	165,661,450	TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	166,447,380	165,661,450

CUENTAS DE ORDEN

Valores entregados en custodia	154,476,067	152,075,460	Capital social autorizado	126,259,200	126,259,200
Valores entregados en custodia por reporto	1,528,550	4,228,716	Acciones emitidas	25,000,019,801	25,000,019,801
Valores prestados	2,804,615	699,302	Acciones en circulación, posición propia	117,370,330	116,077,464
Garantías recibidas por valores prestados	2,982,131	748,683	Acciones de Siefores, posición de terceros	2	2
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	167,905	65,352	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	15,643,013,403	15,603,909,387
Bancos divisas en moneda extranjera	62,057	75,775			
Dólares americanos	38,849	27,820			
Euros	278	1,062			
Yenes	22,930	46,893			
Divisas por recibir	285				
Dólares americanos	285				
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	7,881,896	4,200,496			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	303,836,366	349,787,535			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	13,742,499	16,644,589			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	21,607,729	26,627,558			
Contratos Adelantados sobre Euros	5,279,796	2,590,826			
Contratos de Futuros sobre Renta Fija (Tasas)		1,373,327			
Contratos de Futuros sobre Renta Variable Extranjera	378,418	296,356			
Contratos de Opciones sobre Renta Variable Nacional	3,526	3,526			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	94,745,955	106,302,419			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	35,063,329	31,790,997			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	3,422,572	4,459,135			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	1,941,736				
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	94,614,911	113,252,318			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	30,084,110	43,298,263			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	2,951,785	3,148,221			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	286,148,931	327,360,757			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	1,483,578	124,746			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	19,027,870	7,205,325			
Contratos Adelantados sobre Euros	2,330,912	4,308,548			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas		1,511,917			
Contratos de Futuros sobre Renta Variable Nacional	293,538	1,153,445			
Contratos de Futuros sobre Dólar Americano		10,654,212			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	89,458,239	107,367,253			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	33,518,939	44,688,776			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	5,531,975	8,707,682			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	3,694,375	3,966,683			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	92,866,174	104,888,460			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	36,001,595	32,783,710			
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:	\$ 2,026,458	\$ 8,065,774
Un valor de los activos netos de:	\$ 158,112,481	\$ 157,856,861
El precio de la acción de:	\$ 10.032274	\$ 10.041793

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 DICIEMBRE DE 2018 Y 2017

(Cifras en miles de pesos)

	2018	2017
Ingresos por la venta de Valores	40,176,474	70,412,331
Intereses, dividendos, premios y derechos	9,223,355	8,617,091
Resultado cambiario / Otros productos	(351,474)	(529,270)
Resultados por Intermediación con Instrumentos Financieros Derivados	(447,629)	3,446,372
INGRESOS NETOS	48,600,726	81,946,524
Costo de ventas de valores	40,763,114	68,788,198
Gastos generales	163,200	92,820
Comisiones sobre saldos	1,654,997	1,583,258
Comisiones por servicios de tercerización	21,137	10,734
Intereses sobre inversiones en valores a entregar	225,246	256,874
EGRESOS NETOS	42,827,694	70,731,884
UTILIDAD DE OPERACIÓN	5,773,032	11,214,640
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(6,039,316)	2,556,402
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	(266,284)	13,771,042

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 29 de Noviembre de 2018, fueron aprobados los Estados Financieros al 30 de Septiembre de 2018, asimismo, los presentes Estados Financieros al 31 Diciembre de 2018 fueron aprobados en la Sesión del Consejo de Administración con fecha 13 de Febrero de 2019.