

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 2015 Y 2014

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2015	2014	PASIVO	2015	2014
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	1,706	10	Divisas por entregar	46,562	39,144
Bancos monedas extranjeras	101,095	286,962	Acreedores	177,905	562,392
Divisas por recibir	261		Provisiones para gastos	3,857	3,534
	103,062	286,972	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	5,443,708	4,168,089
INVERSIONES			TOTAL PASIVO	5,672,032	4,773,159
Inversión en valores de renta variable	15,177,795	13,468,982			
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	3,995,603	3,291,502			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	34,633,274	32,050,514			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	2,892,321	3,685,871			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	49,004,903	35,580,285			
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	688,382	1,133,491			
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	2,094,733	2,375,827			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	603,938	216,256			
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	130,402				
Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	1,457				
Inversión en FIBRAS	3,292,441	1,978,285			
Plus (Minus) valía en Inversión en FIBRAS	(54,133)	479,523			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	640,437	990,987			
Inversión en valores extranjeros de deuda	1,986,825	1,839,913			
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	242,162	240,602			
Inversión en títulos Fiduciarios	4,058,554	3,469,569			
Plus (minus) valía en Títulos Fiduciarios	1,150,524	973,838			
Inversión en instrumentos de deuda por reporto	3,332,840	4,413,065			
Plus (Minus) valía de valores por reporto	6,517	5,502			
Valores Prestados	632,121	231,235			
Plus (Minus) valía de valores prestados	(13,435)	67			
	124,497,661	106,425,314			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	125,207	190			
Dividendos o derechos por cobrar	19,651	13,307			
Intereses devengados sobre valores	1,448,029	1,139,313			
Reportos	(6,514)	(5,498)			
Premios por cobrar por préstamo de valores	31	3			
Intereses devengados por instrumentos recibidos en reporto	5,109	6,110			
Intereses devengados sobre valores prestados	5,817	1,529			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	3,929,892	3,895,286			
	5,527,222	5,050,240			
TOTAL ACTIVO	130,127,945	111,762,526	TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	130,127,945	111,762,526

CUENTAS DE ORDEN	2015	2014	CUENTAS DE ORDEN	2015	2014
Valores entregados en custodia	119,899,183	100,784,459	Capital social autorizado	27,500,100	27,500,100
Valores entregados en custodia por reporto	3,337,952	4,419,180	Acciones emitidas	27,500,100,000	27,500,100,000
Valores prestados	618,686	231,303	Acciones en circulación, posición propia	108,272,205	103,272,082
Garantías recibidas por préstamo de valores	666,461	247,319	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	14,536,799,474	12,709,115,305
Bancos divisas en moneda extranjera	360,055	530,013			
Dólares americanos	2,991	13,405			
Euros	10	2,589			
Yenes	357,054	514,019			
Divisas por recibir	15				
Dólares americanos	15				
Divisas por entregar	2,754	2,914			
Dólares americanos	2,754	2,914			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	2,557,979	1,536,148			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	202,475,898	165,182,185			
Contratos Adelantados sobre Renta Fija (Bonos)	590,967	1,753,654			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	10,202,006	6,703,345			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	1,561,316	1,411,000			
Contratos Adelantados sobre Euros	1,322,878				
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	201,143				
Contratos Futuros sobre Renta Fija (Tasas)	21,326,141	31,264,427			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional		91,270			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	43,851,152	35,857,242			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	16,305,530	10,280,955			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	3,638,988	2,198,562			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	67,248,753	47,545,909			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	36,099,606	27,948,403			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	127,418	127,418			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	194,360,674	142,457,940			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	711,125				
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	10,744,828	320,952			
Contratos Adelantados sobre Euros	3,702,423	3,785,329			
Contratos Adelantados sobre Yenes	1,603,095	1,648,122			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	201,890				
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	10,067,613	12,712,741			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	62,501,885	43,458,739			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	34,892,561	26,830,860			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	6,751,808	6,068,636			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	585,700	585,700			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	45,906,528	36,380,219			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	16,691,218	10,666,642			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$ 9,506,820	\$ 10,021,151
Un valor de los activos netos de:	\$ 124,455,913	\$ 106,989,367
El precio de la acción de:	\$ 8.498143	\$ 8.350463

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 2015 Y 2014

(Cifras en miles de pesos)

	2015	2014
Ingresos por la venta de Valores	27,624,830	14,885,163
Intereses, dividendos, premios y derechos	4,668,501	3,824,133
Resultado cambiario / Otros productos	719,905	100,473
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	(3,920,652)	181,683
INGRESOS NETOS	29,092,584	18,991,452
Costo de ventas de valores	25,593,812	14,083,841
Gastos generales	17,248	15,269
Comisiones sobre saldos	1,034,865	848,692
Intereses sobre inversiones en valores a entregar	109,153	158,311
EGRESOS NETOS	26,755,078	15,106,113
UTILIDAD DE OPERACIÓN	2,337,506	3,885,339
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	9,506,820	10,021,151
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	11,844,326	13,906,490

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.