

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 2015 Y 2014

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2015	2014	PASIVO	2015	2014
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	348	10	Acreedores	-	447,789
Bancos monedas extranjeras	1,450,274	764,641	Provisiones para gastos	16,041	8,504
Divisas por recibir	1,963	1,190	Divisas por entregar	646,826	-
	1,452,585	765,841	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	6,223,463	6,831,715
INVERSIONES			TOTAL PASIVO	6,886,330	7,288,008
Inversión en valores de renta variable	15,518,981	15,171,870			
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	4,679,376	4,390,022			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	36,058,209	32,613,863			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	1,493,604	4,267,175			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	55,092,728	47,728,072			
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(158,149)	2,213,034			
Depósito Traspaso Banxico	3,783	-			
Plus (Minus) valía en inversión en el Depósito Traspaso Banxico	2	-			
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	2,442,377	2,920,105			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	638,751	533,611			
Inversión en FIBRAS	4,697,650	3,305,718			
Plus (Minus) valía en Inversion en FIBRAS	154,811	725,059			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	566,850	1,127,896			
Inversión en valores extranjeros de deuda	1,811,086	2,031,490			
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	236,051	279,336			
Inversión en títulos Fiduciarios	6,019,983	5,554,857			
Plus (minus) valía en Títulos Fiduciarios	1,478,333	1,879,116			
Inversión en instrumentos de deuda por reporto	1,913,670	3,259,288			
Plus (Minus) valía de valores por reporto	1,370	5,099			
Valores Prestados	475,558	-			
Plus (Minus) valía de valores prestados	(28,850)	-			
	133,096,174	128,005,611			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	651,483	604,875			
Dividendos o derechos por cobrar	4,557	5,652			
Intereses devengados sobre valores	642,891	539,707			
Reportos	(1,399)	(5,074)			
Premios por cobrar por préstamo de valores	50	-			
Intereses devengados por instrumentos recibidos en reporto	1,961	4,231			
Premios por cobrar por incumplimientos	-	-			
Intereses devengados sobre valores prestados	8,649	-			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	5,356,090	6,343,412			
	6,664,282	7,492,803			
TOTAL ACTIVO	141,213,041	136,264,255	TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	141,213,041	136,264,255

CUENTAS DE ORDEN	2015	2014	CUENTAS DE ORDEN	2015	2014
Valores entregados en custodia	130,167,576	123,613,328	Capital social autorizado	126,259,200	126,259,200
Valores entregados en custodia por reporto	1,915,603	3,263,544	Acciones emitidas	25,000,019,801	25,000,019,801
Valores prestados	446,708	-	Acciones en circulación, posición propia	112,956,353	112,956,353
Garantías recibidas por préstamo de valores	491,475	-	Acciones de Siefos, posición de terceros	2	2
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	23,906	-	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	14,696,186,990	14,099,565,925
Bancos divisas en moneda extranjera	673,287	1,955,937			
Dólares americanos	78,535	35,414			
Euros	554	349			
Yenes	594,198	1,920,174			
Divisas por recibir	114	81			
Dólares americanos	114	81			
Divisas por entregar	37,500	-			
Dólares americanos	37,500	-			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	4,108,670	2,453,205			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	282,106,066	253,212,487			
Contratos Adelantados sobre Renta Fija (Bonos)	4,243,305	4,756,355			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	12,925,913	12,799,106			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	1,486,732	481,096			
Contratos Adelantados sobre Euros	1,220,342	-			
Contratos Adelantados sobre Yenes	142,350	372,441			
Contratos Futuros sobre Renta Fija (Tasas)	34,729,856	52,400,792			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	-	912,280			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	69,428,201	57,288,444			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	16,392,383	12,472,862			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	4,703,888	2,853,710			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	92,767,857	72,093,933			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	43,868,803	36,585,032			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	196,436	196,436			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	254,034,210	203,932,799			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	11,683,936	-			
Contratos Adelantados sobre Euros	3,036,899	5,124,006			
Contratos Adelantados sobre Yenes	2,395,108	2,287,624			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	603,157	-			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	8,702,832	14,722,451			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	86,622,643	66,067,441			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	42,141,832	34,821,791			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	8,802,254	8,730,245			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	850,009	850,009			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	71,607,722	57,687,600			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	17,587,818	13,641,632			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$ 8,493,929	\$ 14,287,353
Un valor de los activos netos de:	\$ 134,326,711	\$ 128,976,247
El precio de la acción de:	\$ 9.070525	\$ 9.074832

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 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 2015 Y 2014

(Cifras en miles de pesos)

	2015	2014
Ingresos por la venta de Valores	47,308,725	42,150,120
Intereses, dividendos, premios y derechos	6,883,455	6,296,895
Resultado cambiario / Otros productos	883,797	471,239
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	(3,144,434)	(442,266)
INGRESOS NETOS	51,931,543	48,475,988
Costo de ventas de valores	44,711,604	40,214,997
Gastos generales	22,829	28,382
Comisiones sobre saldos	1,491,095	1,361,260
Intereses sobre inversiones en valores a entregar	93,950	125,244
EGRESOS NETOS	46,319,478	41,729,883
UTILIDAD DE OPERACIÓN	5,612,065	6,746,105
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	8,493,929	14,287,353
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	14,105,994	21,033,458

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 27 de Noviembre 2015, fueron aprobados los Estados Financieros al 30 de Septiembre 2015 y 2014, así mismo, los presentes Estados Financieros al 31 de Diciembre de 2015 y 2014 serán aprobados en la sesión de Consejo de Administración que se lleve a cabo el próximo 4 de Febrero del 2016.