

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 30 DE SEPTIEMBRE DE 2015 Y 2014

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2015	2014	PASIVO	2015	2014
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	1,801	10	Divisas por entregar	79,907	45,562
Bancos monedas extranjeras	106,619	457,404	Acreedores	210,183	654,518
Divisas por recibir	291		Provisiones para gastos	4,102	4,102
	108,711	457,414	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	76,517,889	6,150,192
INVERSIONES			TOTAL PASIVO	7,945,981	6,854,374
Inversión en valores de renta variable	17,253,462	16,721,115			
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	3,960,391	3,788,220			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	34,283,230	33,513,835			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	2,545,735	3,489,843			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	52,700,817	45,369,487			
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	461,769	1,030,229			
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	2,357,075	2,847,252			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	658,666	256,452			
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	199,626				
Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	1,528				
Inversión en FIBRAS	4,652,675	3,017,009			
Plus (Minus) valía en Inversión en FIBRAS	(79,462)	723,117			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	653,014	1,236,923			
Inversión en valores extranjeros de deuda	2,031,490	2,031,490			
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	245,323	263,090			
Inversión en títulos Fiduciarios	5,851,457	5,400,011			
Plus (minus) valía en Títulos Fiduciarios	1,680,488	1,522,703			
Inversión en instrumentos de deuda por reporto	2,700,699	1,040,490			
Plus (Minus) valía de valores por reporto	6,515	(41)			
Valores Prestados	591,152	353,074			
Plus (Minus) valía de valores prestados	(11,841)	3,517			
	132,743,809	122,607,816			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	149,556	227			
Dividendos o derechos por cobrar	14,271	11,993			
Intereses devengados sobre valores	1,520,856	1,353,944			
Reportos	(6,512)	42			
Premios por cobrar por préstamo de valores	30	4			
Intereses devengados por instrumentos recibidos en reporto	2,956	1,788			
Intereses devengados sobre valores prestados	5,118	2,357			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	5,543,040	5,762,843			
	7,229,315	7,133,198			
TOTAL ACTIVO	140,081,835	130,198,428	TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	140,081,835	130,198,428

CUENTAS DE ORDEN	2015	2014	CUENTAS DE ORDEN	2015	2014
Valores entregados en custodia	128,804,270	119,973,852	Capital social autorizado	126,259,200	126,259,200
Valores entregados en custodia por reporto	2,703,658	1,042,279	Acciones emitidas	25,000,019,801	25,000,019,801
Valores prestados	579,311	356,592	Acciones en circulación, posición propia	112,956,354	115,811,539
Garantías recibidas por préstamo de valores	624,740	381,283	Acciones de Siefiores, posición de terceros	2	2
Bancos divisas en moneda extranjera	157,309	806,542	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	14,756,354,437	13,995,352,641
Dólares americanos	5,026	22,134			
Euros	10	3,799			
Yenes	152,273	780,609			
Divisas por recibir	17				
Dólares americanos	17				
Divisas por entregar	4,727	3,392			
Dólares americanos	4,727	3,392			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	3,629,293	2,392,905			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	279,554,395	254,690,005			
Contratos Adelantados sobre Renta Fija (Bonos)	5,440,355	5,392,104			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	16,482,526	10,708,116			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	1,455,867	2,116,910			
Contratos Adelantados sobre Euros	1,412,079				
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	268,191				
Contratos Futuros sobre Renta Fija (Tasas)	39,147,590	56,818,525			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional		1,827,570			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	63,519,776	57,176,444			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	16,392,383	12,472,862			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	4,558,218	2,753,857			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	88,454,227	68,989,085			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	42,226,747	36,238,096			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	196,436	196,436			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	245,795,844	200,427,289			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	907,163				
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	12,069,823	468,055			
Contratos Adelantados sobre Euros	4,601,191	5,163,969			
Contratos Adelantados sobre Yenes	2,431,096	2,461,009			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	269,187				
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	9,896,053	14,200,073			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	82,373,153	62,962,593			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	40,499,775	34,623,289			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	8,756,959	8,730,245			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	850,009	850,009			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	65,553,617	57,326,415			
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:	\$ 9,462,597	\$ 11,077,171
Un valor de los activos netos de:	\$ 132,135,854	\$ 123,344,054
El precio de la acción de:	\$ 8.886481	\$ 8.740884

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 30 DE SEPTIEMBRE DE 2015 Y 2014

(Cifras en miles de pesos)

	2015	2014
Ingresos por la venta de Valores	35,076,794	25,464,568
Intereses, dividendos, premios y derechos	5,002,840	4,557,319
Resultado cambiario / Otros productos	680,279	157,279
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	(4,639,835)	754,467
INGRESOS NETOS	36,120,078	30,933,633
Costo de ventas de valores	32,948,751	24,572,913
Gastos generales	18,942	20,960
Comisiones sobre saldos	1,099,578	993,843
Intereses sobre inversiones en valores a entregar	70,140	114,633
EGRESOS NETOS	34,137,411	25,702,349
UTILIDAD DE OPERACIÓN	1,982,667	5,231,284
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	9,462,597	11,077,171
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	11,445,264	16,308,455

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.