

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 31 DE DICIEMBRE DE 2018 Y 2017

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2018	2017	PASIVO	2018	2017
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	(162,728)	10	Acreedores	470,103	18,076
Bancos monedas extranjeras	1,042,745	586,268	Provisiones para gastos	16,073	23,867
Divisas por recibir	7,211		Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	7,348,902	6,294,364
	887,228	586,278	TOTAL PASIVO	7,835,078	6,336,307
INVERSIONES					
Inversión en valores de renta variable	26,482,841	15,724,532			
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	(307,944)	3,980,730			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	79,842,498	64,857,857			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	5,360,454	4,667,949			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	49,083,990	55,001,922			
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(3,709,453)	(3,123,600)			
Inversiones tercerizadas	3,250,938	2,214,871			
Plus (Minus) valía en Inversiones tercerizadas	221,322	498,952			
Depósito Traspaso Banxico	412,738	301,511			
Plus (Minus) valía en inversión en el Depósito Traspaso Banxico	145	82			
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	9,964,796	10,922,774			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	321,444	1,717,619			
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	4,866,024	1,758,904			
Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	(158,035)	53,164			
Inversión en FIBRAS	6,222,606	5,485,079			
Plus (Minus) valía en Inversion en FIBRAS	(1,881,289)	(742,843)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	3,780	46,743			
Inversión en valores extranjeros de deuda	686,416	961,994			
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	18,737	90,367			
Inversión en títulos Fiduciarios	9,018,677	6,687,151			
Plus (minus) valía en Títulos Fiduciarios	1,826,654	1,491,369			
Inversión en instrumentos de deuda por reporto	2,207,287	6,401,284			
Plus (Minus) valía de valores por reporto	4,388	5,159			
Valores Prestados	3,240,959	917,135			
Plus (Minus) valía de valores prestados	12,978	(34,016)			
	196,992,951	179,886,689			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	209,775	176			
Dividendos o derechos por cobrar	1,873	98,625			
Intereses devengados sobre valores	1,138,116	1,126,121			
Reportos	(4,406)	(5,130)			
Premios por cobrar por préstamo de valores	110	42			
Intereses devengados por instrumentos recibidos en reporto	11,373	88,364			
Intereses devengados sobre valores prestados	51,540	3,976			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	4,443,466	5,557,240			
	5,851,847	6,869,414			
TOTAL ACTIVO	203,732,026	187,342,381			
			CAPITAL CONTABLE		
			CAPITAL		
			CAPITAL CONTRIBUIDO	83,776,171	69,393,717
			Capital social pagado	20,434,580	18,940,042
			Prima en venta de acciones	63,341,591	50,453,675
			CAPITAL GANADO	110,415,764	103,012,585
			Resultados de ejercicios anteriores	103,012,585	89,628,668
			Resultados del ejercicio	7,403,179	13,383,917
			OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
			PLUS (MINUS) VALÍAS	1,705,013	8,599,772
			TOTAL CAPITAL CONTABLE	195,896,948	181,006,074
			TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	203,732,026	187,342,381

CUENTAS DE ORDEN

Valores entregados en custodia	190,744,758	172,550,383	Capital social autorizado	27,500,100	27,500,100
Valores entregados en custodia por reporto	2,218,642	6,489,676	Acciones emitidas	27,500,100,000	27,500,100,000
Valores prestados	3,253,938	883,119	Acciones en circulación, posición propia	151,196,312	139,689,309
Garantías recibidas por valores prestados	3,494,402	942,951	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	20,283,383,309	18,800,353,001
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	218,538	54,953			
Bancos divisas en moneda extranjera	69,597	72,800			
Dólares americanos	52,640	28,030			
Euros	236	1,164			
Yenes	16,721	43,606			
Divisas por recibir	367				
Dólares americanos	367				
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	7,396,986	3,924,291			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	315,669,675	328,311,385			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	12,409,082	13,465,304			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	24,414,774	31,249,363			
Contratos Adelantados sobre Euros	4,559,845	2,642,680			
Contratos de Futuros sobre Renta Fija (Tasas)		207,126			
Contratos de Futuros sobre Renta Variable Extranjera	54,805				
Contratos de Opciones sobre Renta Variable Nacional	3,122	3,511			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	95,399,955	90,478,233			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	34,212,873	34,452,181			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	3,319,368	3,574,943			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	2,247,090				
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	100,136,715	101,150,995			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	35,593,724	47,641,309			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	3,318,322	3,445,740			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	300,620,466	309,490,277			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	1,571,196	122,684			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	21,649,299	10,349,607			
Contratos Adelantados sobre Euros	2,027,351	4,937,905			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas		1,246,032			
Contratos de Futuros sobre Renta Variable Nacional	993,578	1,125,971			
Contratos de Futuros sobre Dólar Americano		10,884,722			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	95,036,226	96,195,314			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	39,344,659	49,812,842			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	5,225,850	7,098,472			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	4,296,034	4,335,563			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	93,086,929	88,676,409			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	35,142,254	34,704,756			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	2,247,090				

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$ 1,705,013	\$ 8,599,772
Un valor de los activos netos de:	\$ 195,896,948	\$ 181,006,074
El precio de la acción de:	\$ 9.586542	\$ 9.556794

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 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 31 DE DICIEMBRE DE 2018 Y 2017

(Cifras en miles de pesos)

	2018	2017
Ingresos por la venta de Valores	43,265,456	75,504,854
Intereses, dividendos, premios y derechos	10,492,877	9,019,780
Resultado cambiario / Otros productos	(335,384)	(635,526)
Resultados por Intermediación con Instrumentos Financieros Derivados	(43,165)	2,962,450
INGRESOS NETOS	53,379,784	86,851,558
Costo de ventas de valores	43,593,030	71,380,112
Gastos generales	175,903	99,535
Comisiones sobre saldos	1,905,356	1,691,457
Comisiones por servicios de tercerización	19,680	9,748
Intereses sobre inversiones en valores a entregar	282,636	286,789
EGRESOS NETOS	45,976,605	73,467,641
UTILIDAD DE OPERACIÓN	7,403,179	13,383,917
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(6,894,758)	1,089,174
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	508,421	14,473,091

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.