

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 2018 Y 2017

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2018	2017	PASIVO	2018	2017
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	9	10	Divisas por entregar		428,360
Bancos monedas extranjeras	189,741	674,814	Acreedores	44	379,089
	189,750	674,824	Provisiones para gastos	21,115	19,442
INVERSIONES			Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	6,265,512	4,205,520
Inversión en valores de renta variable	22,691,682	16,099,954	TOTAL PASIVO	6,286,671	5,032,411
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	2,449,579	3,390,870			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	75,841,108	57,157,799			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	5,878,776	5,186,369			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	44,718,961	50,277,108			
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(2,282,205)	(734,444)			
Inversiones tercerizadas	3,250,938	2,214,871			
Plus (Minus) valía en Inversiones tercerizadas	524,512	123,417			
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	10,664,800	10,507,029			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	231,776	744,234			
Instrumentos otorgados en garantía por Operaciones Derivadas	2,102,035	1,271,923			
Plus Minus valía en Instrumentos otorgados en garantía por Operaciones Derivadas	57,693	59,881			
Inversión en FIBRAS	5,971,474	4,806,915			
Plus (Minus) valía en Inversion en FIBRAS	(1,225,753)	(426,667)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	5,229	24,420			
Inversión en valores extranjeros de deuda	656,863	2,090,655			
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	34,227	10,900			
Inversión en títulos Fiduciarios	8,393,975	5,718,247			
Plus (minus) valía en Títulos Fiduciarios	1,992,747	1,324,673			
Inversión en instrumentos de deuda por reporto	2,369,592	1,276,726			
Plus (Minus) valía de valores por reporto	5,753	2,436			
Valores Prestados	3,560,654	2,215,847			
Plus (Minus) valía de valores prestados	75,897	104,388			
	187,970,313	163,447,551			
DEUDORES DIVERSOS			CAPITAL CONTABLE	2018	2017
Liquidadora	28,578	629,798			
Dividendos o derechos por cobrar	83,606	67,966			
Intereses devengados sobre valores	1,943,882	1,802,394			
Reportos	(5,752)	(2,439)			
Premios por cobrar por préstamo de valores	300	57			
Intereses devengados por instrumentos recibidos en reporto	12,901	6,275			
Intereses devengados sobre valores prestados	47,129	19,934			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	5,584,406	5,544,584			
	7,695,050	8,068,569			
TOTAL ACTIVO	195,855,113	172,190,944	CAPITAL		
			CAPITAL CONTRIBUIDO	71,166,862	57,186,586
			Capital social pagado	19,123,862	17,599,516
			Prima en venta de acciones	52,043,000	39,587,070
			CAPITAL GANADO	110,664,331	100,188,327
			Resultados de ejercicios anteriores	103,012,585	89,628,668
			Resultados del ejercicio	7,651,746	10,559,659
			OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
			PLUS (MINUS) VALÍAS	7,737,249	9,783,620
			TOTAL CAPITAL CONTABLE	189,568,442	167,158,533
			TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	195,855,113	172,190,944

CUENTAS DE ORDEN	2018	2017	CUENTAS DE ORDEN	2018	2017
Valores entregados en custodia	181,605,387	159,823,734	Capital social autorizado	27,500,100	27,500,100
Valores entregados en custodia por reporto	2,382,493	1,282,998	Acciones emitidas	27,500,100,000	27,500,100,000
Valores prestados	3,636,551	2,320,235	Acciones en circulación, posición propia	141,144,726	129,554,252
Garantías recibidas por valores prestados	3,903,928	2,476,321	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	18,982,716,896	17,469,961,401
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	391,646	900,926			
Bancos divisas en moneda extranjera	49,560	339,344			
Dólares americanos	9,304	32,878			
Euros	413	1,330			
Yenes	39,843	305,136			
Divisas por entregar		23,589			
Dólares americanos		23,589			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	6,545,119	3,780,384			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	321,639,357	342,670,518			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	13,404,175	10,328,848			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	30,490,920	31,376,716			
Contratos Adelantados sobre Euros	3,238,899	675,576			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	672,876				
Contratos de Futuros sobre Renta Fija de (Tasas)		1,449,568			
Contratos de Futuros sobre Renta Variable Extranjera	59,070				
Contratos de Opciones sobre Renta Variable Nacional	3,511	3,153			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	94,525,769	87,451,733			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	29,839,902	46,962,105			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	3,508,537	3,574,943			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	2,247,090				
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	104,640,042	101,020,649			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	35,690,244	56,626,496			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	3,318,322	3,200,731			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	307,292,689	335,361,694			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	2,706,570				
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	25,373,832	20,383,670			
Contratos Adelantados sobre Euros	1,538,427	4,065,055			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	675,758	933,772			
Contratos de Futuros sobre Renta Variable Nacional	1,286,584	212,625			
Contratos de Futuros sobre Dólar Americano	1,818,219	10,860,414			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	98,967,556	96,064,968			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	39,135,415	58,159,253			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	5,884,601	7,098,472			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	4,277,266	4,043,401			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	92,460,929	86,325,384			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	30,920,442	47,214,680			
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:	\$ 7,737,249	\$ 9,783,620
Un valor de los activos netos de:	\$ 189,568,442	\$ 167,158,533
El precio de la acción de:	\$ 9.912665	\$ 9.497905

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 30 DE SEPTIEMBRE DE 2018 Y 2017

(Cifras en miles de pesos)

	2018	2017	
Ingresos por la venta de Valores	35,570,504	55,124,506	
Intereses, dividendos, premios y derechos	7,682,978	6,249,511	
Resultado cambiario / Otros productos	(244,351)	(676,097)	
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	2,202,012	3,200,225	
INGRESOS NETOS	45,211,143	63,898,145	
Costo de ventas de valores	35,783,294	51,791,671	
Gastos generales	102,996	72,577	
Comisiones sobre saldos	1,405,739	1,235,107	
Comisiones por servicios de tercerización	14,549	6,465	
Intereses sobre inversiones en valores a entregar	252,819	232,666	
EGRESOS NETOS	37,559,397	53,338,486	
UTILIDAD DE OPERACIÓN	7,651,746	10,559,659	
OTROS RESULTADOS INTEGRALES			
PLUS (MINUS) VALÍAS	(862,522)	2,273,022	
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	6,789,224	12,832,681	

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.

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS:

En la Sesión del Consejo de Administración con fecha 30 de agosto de 2018, fueron aprobados los Estados Financieros al 30 de junio de 2018, asimismo, los presentes Estados Financieros al 30 de septiembre de 2018 serán aprobados en la Sesión del Consejo de Administración que se llevará a cabo el próximo 29 de noviembre de 2018.