

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 2017 Y 2016

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2017	2016	PASIVO	2017	2016
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	10	9	Acreedores	68,306	37,909
Bancos monedas extranjeras	580,286	1,956,825	Provisiones para gastos	21,649	12,733
Divisas por recibir		1	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	7,714,634	8,734,836
	580,296	1,956,835	TOTAL PASIVO	7,804,589	8,785,478
INVERSIONES			CAPITAL CONTABLE	2017	2016
Inversión en valores de renta variable	14,246,123	14,875,870	CAPITAL		
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	3,395,696	3,498,181	CAPITAL CONTRIBUIDO	95,656,101	94,980,451
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	55,405,957	39,308,483	Capital social pagado	79,391,656	78,998,364
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	4,043,353	3,256,247	Prima en venta de acciones	16,264,445	15,982,087
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	46,114,494	49,718,594	CAPITAL GANADO	54,134,986	42,920,345
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(2,652,632)	(4,132,188)	Resultados de ejercicios anteriores	42,920,346	38,506,997
Inversiones tercerizadas	2,439,637		Resultados del ejercicio	11,214,640	4,413,348
Plus (Minus) valía en Inversiones tercerizadas	549,798		OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
Depósito Traspaso Banxico		8,209	PLUS (MINUS) VALÍAS	8,065,774	5,509,372
Plus (Minus) valía en inversión en el Depósito Traspaso Banxico		2	TOTAL CAPITAL CONTABLE	157,856,861	143,410,168
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	9,434,571	7,180,778			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	1,555,949	1,363,603			
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	2,050,803	2,237,942			
Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	75,394	63,298			
Inversión en FIBRAS	5,639,263	5,048,749			
Plus (Minus) valía en Inversion en FIBRAS	(813,476)	(563,916)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	351,138	351,939			
Inversión en valores extranjeros de deuda	831,465	4,197,290			
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	74,627	97,412			
Inversión en títulos Fiduciarios	7,910,814	6,605,617			
Plus (minus) valía en Títulos Fiduciarios	1,866,424	1,926,733			
Inversión en instrumentos de deuda por reporto	4,217,690	5,432,408			
Plus (Minus) valía de valores por reporto	9,620	6,870			
Valores Prestados	728,661	-			
Plus (Minus) valía de valores prestados	(29,359)	-			
	157,446,010	140,482,121			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	722	745,148			
Dividendos o derechos por cobrar	120,435	8,759			
Intereses devengados sobre valores	951,806	738,937			
Reportos	(9,681)	(6,951)			
Premios por cobrar por préstamo de valores	33	-			
Intereses devengados por instrumentos recibidos en reporto	11,088	9,641			
Intereses devengados sobre valores prestados	3,132	-			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	6,557,609	8,261,156			
	7,635,144	9,756,690			
TOTAL ACTIVO	165,661,450	152,195,646	TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	165,661,450	152,195,646

CUENTAS DE ORDEN	2017	2016	CUENTAS DE ORDEN	2017	2016
Valores entregados en custodia	152,075,460	134,690,904	Capital social autorizado	126,259,200	126,259,200
Valores entregados en custodia por reporto	4,228,716	5,441,968	Acciones emitidas	25,000,019,801	25,000,019,801
Valores prestados	699,302	-	Acciones en circulación, posición propia	116,077,464	114,964,727
Garantías recibidas por valores prestados	748,683	-	Acciones de Siefores, posición de terceros	2	2
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	65,352	241,120	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	15,603,909,387	15,527,148,221
Bancos divisas en moneda extranjera	75,775	94,357			
Dólares americanos	27,820	83,549			
Euros	1,062	10,785			
Yenes	46,893	23			
Divisas por recibir		3			
Yenes		3			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	4,200,496	4,380,871			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	349,787,535	320,624,900			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	16,644,589	11,210,230			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	26,627,558	18,299,831			
Contratos Adelantados sobre Euros	2,590,826	186,633			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas		951,305			
Contratos Futuros sobre Renta Fija (Tasas)	1,373,327	17,058,921			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Extranjera	296,356	354,269			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano		757,382			
Contratos Opc. Renta Variable Nacional	3,526				
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	106,302,419	92,059,959			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	31,790,997	33,417,025			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	4,459,135	4,682,066			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	113,252,318	93,659,605			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	43,298,263	47,791,238			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	3,148,221	196,436			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	327,360,757	312,378,951			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	124,746	944,350			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	7,205,325	25,797,448			
Contratos Adelantados sobre Euros	4,308,548	1,388,691			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	1,511,917	1,738,066			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	1,153,445				
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	10,654,212	10,458,054			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	107,367,253	86,832,024			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	44,688,776	46,944,668			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	8,707,682	9,559,927			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	3,966,683	764,665			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	104,888,460	93,541,321			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	32,783,710	34,409,737			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$ 8,065,774	\$ 5,509,372
Un valor de los activos netos de:	\$ 157,856,861	\$ 143,410,168
El precio de la acción de:	\$ 10.041793	\$ 9.168209

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 2017 Y 2016

(Cifras en miles de pesos)

	2017	2016
Ingresos por la venta de Valores	70,412,331	79,861,883
Intereses, dividendos, premios y derechos	8,617,091	7,466,355
Resultado cambiario / Otros productos	(529,270)	389,542
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	3,446,372	(5,374,460)
INGRESOS NETOS	81,946,524	82,343,320
Costo de ventas de valores	68,788,198	76,220,934
Gastos generales	92,820	79,628
Comisiones sobre saldos	1,583,258	1,496,972
Comisiones por servicios de tercerización	10,734	
Intereses sobre inversiones en valores a entregar	256,874	132,438
EGRESOS NETOS	70,731,884	77,929,972
UTILIDAD DE OPERACIÓN	11,214,640	4,413,348
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	2,556,402	(2,984,558)
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	13,771,042	1,428,790

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.

NOTA A LOS ESTADOS FINANCIEROS:

En la Sesión del Consejo de Administración con fecha 7 de Noviembre de 2017, fueron aprobados los Estados Financieros al 30 de Septiembre de 2017 y 2016, asimismo, los presentes Estados Financieros al 31 Diciembre de 2017 y 2016 fueron aprobados en la Sesión del Consejo de Administración con fecha 28 de Febrero de 2018.