

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 JUNIO DE 2017 Y 2016

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2017	2016	PASIVO	2017	2016
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	10	10	Divisas por entregar	248,027	142,808
Bancos monedas extranjeras	503,229	1,086,696	Acreedores	475,325	99,209
Divisas por recibir	216,751	1,489	Provisiones para gastos	17,154	4,189
	719,990	1,088,195	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	7,130,187	8,493,466
INVERSIONES			TOTAL PASIVO	7,870,693	8,739,672
Inversión en valores de renta variable	17,121,211	15,207,426			
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	2,388,115	3,824,656			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	48,700,195	39,203,340			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udis	4,297,800	3,368,196			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	47,931,187	52,287,840			
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(581,502)	1,541,162			
Inversiones tercerizadas	2,439,637				
Plus (Minus) valía en Inversiones tercerizadas	3,291				
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	9,063,947	3,663,187			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	579,834	1,079,932			
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	1,926,245				
Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	70,255				
Inversión en FIBRAS	5,170,097	4,808,852			
Plus (Minus) valía en Inversion en FIBRAS	(197,572)	305,094			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	254,846	869,652			
Inversión en valores extranjeros de deuda	2,592,411	1,179,434			
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	(65,711)	112,215			
Inversión en títulos Fiduciarios	6,865,322	6,186,540			
Plus (minus) valía en Títulos Fiduciarios	1,687,680	1,385,805			
Inversión en instrumentos de deuda por reporto	2,179,581	5,487,968			
Plus (Minus) valía de valores por reporto	3,173	5,822			
Valores Prestados	2,313,499	-			
Plus (Minus) valía de valores prestados	72,403	-			
	154,815,944	140,517,121			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	112,535	571			
Dividendos o derechos por cobrar	1,925	2,449			
Intereses devengados sobre valores	753,895	595,809			
Reportos	(3,132)	(5,796)			
Premios por cobrar por préstamo de valores	58	-			
Intereses devengados por instrumentos recibidos en reporto	16,357	13,004			
Intereses devengados sobre valores prestados	30,816	-			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	7,104,549	7,422,317			
	8,017,003	8,028,354			
TOTAL ACTIVO	163,552,937	149,633,670			
			CAPITAL CONTABLE	2017	2016
			CAPITAL		
			CAPITAL CONTRIBUIDO	98,152,832	90,921,030
			Capital social pagado	80,701,892	76,809,349
			Prima en venta de acciones	17,450,940	14,111,681
			CAPITAL GANADO	49,274,819	38,355,908
			Resultados de ejercicios anteriores	42,920,345	38,506,998
			Resultados del ejercicio	6,354,474	(151,090)
			OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
			PLUS (MINUS) VALÍAS	8,254,593	11,617,060
			TOTAL CAPITAL CONTABLE	155,682,244	140,893,998
			TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	163,552,937	149,633,670



CUENTAS DE ORDEN	2017	2016	CUENTAS DE ORDEN	2017	2016
Valores entregados en custodia	149,992,441	134,153,679	Capital social autorizado	126,259,200	126,259,200
Valores entregados en custodia por reporte	2,195,979	5,500,997	Acciones emitidas	25,000,019,801	25,000,019,801
Valores prestados	2,385,902	-	Acciones en circulación, posición propia	117,273,257	112,956,353
Garantías recibidas por Valores Prestados	2,546,862	-	Acciones de Siefores, posición de terceros	2	2
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	914,271	126,710	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	15,862,147,535	15,095,719,516
Bancos divisas en moneda extranjera	114,630	867,125			
Dólares americanos	7,178	38,983			
Euros	17,414	10,794			
Yenes	90,038	817,348			
Divisas por recibir	12,000	81			
Dólares americanos	12,000	81			
Divisas por entregar	13,732	723,000			
Dólares americanos	13,732	737			
Yenes		722,263			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	4,066,866	3,868,229			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	369,006,868	305,771,992			
Contratos Adelantados sobre Renta Fija (Bonos)		6,423,372			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	11,696,459	5,662,643			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	27,461,820	17,776,829			
Contratos Adelantados sobre Euros	1,536,464	-			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas		884,032			
Contratos Futuros sobre Renta Fija (Tasas)	8,223,453	25,894,388			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Extranjera	256,042	839,803			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	313,500				
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	106,098,996	73,312,254			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	37,565,152	32,763,292			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	4,459,135	4,962,110			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	115,906,389	90,886,209			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	52,384,058	46,170,624			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	3,105,400	196,436			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	363,213,141	271,035,025			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	25,563,494	9,194,005			
Contratos Adelantados sobre Euros	5,441,241	2,917,197			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	1,213,201	3,318,606			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	445,226				
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	10,951,055	7,057,848			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	110,021,325	84,528,320			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	52,319,306	44,572,007			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	8,707,682	9,100,522			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	3,927,865	764,665			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	106,064,881	75,623,128			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	38,557,865	33,958,727			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$ 8,254,593	\$ 11,617,060
Un valor de los activos netos de:	\$ 155,682,244	\$ 140,893,998
El precio de la acción de:	\$ 9.742671	\$ 9.264054

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 JUNIO DE 2017 Y 2016

(Cifras en miles de pesos)

	2017	2016
Ingresos por la venta de Valores	37,215,440	35,258,962
Intereses, dividendos, premios y derechos	4,063,386	3,645,750
Resultado cambiario / Otros productos	(106,272)	205,167
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	2,533,266	(4,690,254)
INGRESOS NETOS	43,705,820	34,419,625
Costo de ventas de valores	36,344,535	33,805,294
Gastos generales	44,047	12,454
Comisiones sobre saldos	767,744	707,712
Comisiones por servicios de tercerización	3,915	
Intereses sobre inversiones en valores a entregar	191,105	45,255
EGRESOS NETOS	37,351,346	34,570,715
UTILIDAD DE OPERACIÓN	6,354,474	(151,090)
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	2,745,222	3,123,131
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	9,099,696	2,972,041

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 23 de mayo de 2017, fueron aprobados los Estados Financieros al 31 de Marzo de 2017 y 2016, asimismo, los presentes Estados Financieros al 30 de junio de 2017 y 2016 serán aprobados en la Sesión del Consejo de Administración que se llevará a cabo el próximo 30 de agosto de 2017.