

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 JUNIO DE 2015 Y DE 2014

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2015	2014	PASIVO	2015	2014
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	10	10	Divisas por entregar	146	206,729
Bancos monedas extranjeras	307,051	140,772	Acreedores	301,368	41,405
Divisas por recibir	5,816	301,687	Provisiones para gastos	4,222	3,256
	312,877	442,469	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	4,425,176	5,312,989
INVERSIONES			TOTAL PASIVO	4,730,912	5,564,378
Inversión en valores de renta variable	15,093,031	12,918,445			
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	5,184,099	2,812,802	CAPITAL CONTABLE	2015	2014
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	37,255,312	29,202,152	CAPITAL		
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	3,448,887	4,311,153	CAPITAL CONTRIBUIDO	30,295,425	13,954,071
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	45,366,068	30,298,933	Capital social pagado	14,424,546	12,393,165
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	962,730	2,300,304	Prima en venta de acciones	15,870,878	1,560,906
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	2,222,064	3,138,620	CAPITAL GANADO	83,781,354	78,028,478
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	512,249	280,972	Resultados de ejercicios anteriores	80,426,423	75,606,875
Inversión en FIBRAS	2,953,672	1,841,948	Resultados del ejercicio	3,354,931	2,421,603
Plus (Minus) valía en Inversion en FIBRAS	113,546	550,461	OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	917,502	1,273,005	PLUS (MINUS) VALÍAS	11,384,162	11,425,630
Inversión en valores extranjeros de deuda	1,986,825	1,839,913	TOTAL CAPITAL CONTABLE	125,460,941	103,408,179
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	249,950	273,481			
Inversión en títulos Fiduciarios	3,813,980	3,349,624			
Plus (minus) valía en Títulos Fiduciarios	921,084	896,456			
Inversión en instrumentos de deuda por reporto	4,155,354	7,653,386			
Plus (Minus) valía de valores por reporto	(2,404)	3,970			
Valores Prestados	300,711	-			
Plus (Minus) valía de valores prestados	(8,384)	-			
	125,446,277	102,945,625			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	393	225,875			
Dividendos o derechos por cobrar	136,538	147,091			
Intereses devengados sobre valores	489,682	393,172			
Reportos	2,498	(3,960)			
Premios por cobrar por préstamo de valores	3	-			
Intereses devengados por instrumentos recibidos en reporto	20,849	13,105			
Intereses devengados sobre valores prestados	5,149	-			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	3,777,586	4,809,179			
	4,432,699	5,584,463			
TOTAL ACTIVO	130,191,853	108,972,557	TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	130,191,853	108,972,557

CUENTAS DE ORDEN	2015	2014	CUENTAS DE ORDEN	2015	2014
Valores entregados en custodia	120,083,498	94,015,265	Capital social autorizado	27,500,100	27,500,100
Valores entregados en custodia por reporto	4,176,298	7,666,500	Acciones emitidas	27,500,100,000	27,500,100,000
Valores prestados	292,327	-	Acciones en circulación, posición propia	108,272,204	103,272,083
Garantías recibidas por valores prestados	315,110	-	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	14,316,273,894	12,289,892,634
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	43,741	-			
Bancos divisas en moneda extranjera	1,145,076	9,822			
Dólar americano	10,288	7,031			
Euros	-	2,791			
Yenes	1,134,788	0			
Divisas por recibir	363	23,258			
Dólar americano	293	23,258			
Euros	70	-			
Divisas por entregar	8	15,938			
Dólar americano	-	15,938			
Euros	8	-			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	1,637,789	920,644			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	190,233,604	164,544,303			
Contratos Adelantados sobre Renta Fija (Bonos)	-	818,470			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	8,832,902	7,475,434			
Contratos Adelantados sobre Dólar americano	1,330,638	143,513			
Contratos Adelantados sobre Euros	-	47,775			
Contratos Adelantados sobre Yenes	274,892	-			
Contratos Futuros sobre Renta Fija (Tasas)	23,810,712	33,748,999			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	-	709,621			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	41,416,207	38,673,877			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar americano	14,869,859	10,229,760			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	3,638,988	2,047,894			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	60,557,638	47,118,874			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar americano	35,374,350	23,402,670			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	127,418	127,418			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	180,100,789	138,450,175			
Contratos Adelantados sobre Dólar americano	1,635,225	-			
Contratos Adelantados sobre Euros	4,915,315	3,574,709			
Contratos Adelantados sobre Yenes	1,658,900	1,631,911			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	612,230	-			
Contratos Futuros sobre Renta Fija (Bonos)	-	78,716			
Contratos Futuros sobre Dólar americano	15,237,961	11,536,040			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	55,810,770	43,031,704			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar americano	34,139,095	22,285,128			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	6,751,808	6,068,636			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	585,700	585,700			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	43,498,239	39,042,184			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar americano	15,255,547	10,615,447			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$ 11,384,162	\$ 11,425,630
Un valor de los activos netos de:	\$ 125,460,941	\$ 103,408,179
El precio de la acción de:	\$ 8.697739	\$ 8.343969

LUIS ROBERTO GUZMÁN GONZÁLEZ

Contador General de SIEFORE

Declaro bajo protesta de decir verdad que los datos contenidos son auténticos y veraces

ENRIQUE SOLÓRZANO PALACIO

Director General

Declaro bajo protesta de decir verdad que los datos contenidos son auténticos y veraces

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 JUNIO DE 2015 Y DE 2014**

(Cifras en miles de pesos)

	2015	2014
Ingresos por la venta de Valores	15,573,042	9,794,932
Intereses, dividendos, premios y derechos	3,104,442	2,581,120
Resultado cambiario / Otros productos	557,631	(94,568)
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	(626,332)	39,921
INGRESOS NETOS	18,608,784	12,321,405
Costo de ventas de valores	14,466,441	9,239,740
Gastos generales	11,473	10,057
Comisiones sobre saldos	682,976	542,938
Intereses sobre inversiones en valores a entregar	92,963	107,068
EGRESOS NETOS	15,253,852	9,899,802
UTILIDAD DE OPERACIÓN	3,354,931	2,421,603
OTROS RESULTADOS INTEGRALES PLUS (MINUS) VALÍAS	11,384,162	11,425,630
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	14,739,093	13,847,233

LUIS ROBERTO GUZMÁN GONZÁLEZ

Contador General de SIEFORE

Declaro bajo protesta de decir verdad que los datos contenidos son auténticos y veraces

ENRIQUE SOLÓRZANO PALACIO

Director General

Declaro bajo protesta de decir verdad que los datos contenidos son auténticos y veraces

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.