

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 MARZO DE 2018 Y 2017

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2018	2017	PASIVO	2018	2017
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	10	1,367	Acreeedores	267,157	3,589,953
Bancos monedas extranjeras	156,204	349,243	Divisas por entregar		1,284,142
Divisas por recibir	1,276	2,506,170	Provisiones para gastos	27,498	13,783
	157,490	2,856,780	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	6,770,837	8,426,703
INVERSIONES			TOTAL PASIVO	7,065,492	13,314,581
Inversión en valores de renta variable	16,978,469	17,767,889			
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	1,920,814	2,886,427			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	58,595,895	43,266,766			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	4,157,757	3,565,060			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	38,645,190	43,560,170			
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(1,584,131)	(1,645,851)			
Inversiones tercerizadas	3,488,726	2,439,637	CONTABLE	2018	2017
Plus (Minus) valía en Inversiones tercerizadas	194,993	(28,222)			
Depósito Traspaso Banxico		8,244	CAPITAL		
Plus (Minus) valía en inversión en el Depósito Traspaso Banxico		240	CAPITAL CONTRIBUIDO	97,312,407	96,987,974
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	8,897,682	8,503,970	Capital social pagado	80,219,904	80,084,142
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	392,396	782,507	Prima en venta de acciones	17,092,503	16,903,832
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	2,702,228	2,076,355			
Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	78,656	55,468	CAPITAL GANADO	55,951,124	46,334,106
Inversión en FIBRAS	6,134,289	5,048,749	Resultados de ejercicios anteriores	54,134,985	42,920,345
Plus (Minus) valía en Inversion en FIBRAS	(966,118)	(451,252)	Resultados del ejercicio	1,816,139	3,413,761
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	66,176	291,260	OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
Inversión en valores extranjeros de deuda	572,141	2,695,683	PLUS (MINUS) VALÍAS	6,736,282	7,249,549
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	36,803	(40,289)			
Inversión en títulos Fiduciarios	8,123,756	6,683,477	TOTAL CAPITAL CONTABLE	159,999,813	150,571,629
Plus (minus) valía en Títulos Fiduciarios	2,488,724	2,139,033			
Inversión en instrumentos de deuda por reporto	4,692,893	9,893,675			
Plus (Minus) valía de valores por reporto	3,329	95,874			
Valores Prestados	4,043,289	668,097			
Plus (Minus) valía de valores prestados	16,389	(13,572)			
	159,680,346	150,249,395			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	459,031	1,268,645			
Dividendos o derechos por cobrar	47,656	3,634			
Intereses devengados sobre valores	1,615,198	1,532,240			
Reportos	(3,110)	(97,023)			
Premios por cobrar por préstamo de valores	245	17			
Intereses devengados por instrumentos recibidos en reporto	22,198	248,686			
Intereses devengados sobre valores prestados	70,492	7,413			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	5,015,759	7,816,423			
	7,227,469	10,780,035			
TOTAL ACTIVO	167,065,305	163,886,210	TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	167,065,305	163,886,210

CUENTAS DE ORDEN	2018	2017	CUENTAS DE ORDEN	2018	2017
Valores entregados en custodia	149,934,470	139,314,061	Capital social autorizado	126,259,200	126,259,200
Valores entregados en custodia por reporto	4,715,310	10,141,212	Acciones emitidas	25,000,019,801	25,000,019,801
Valores prestados	4,059,678	654,525	Acciones en circulación, posición propia	117,564,831	114,964,726
Garantías recibidas por préstamo de valores	4,368,355	702,961	Acciones de Siefos, posición de terceros	2	2
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	115,568	358,795	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	15,766,419,777	15,742,138,293
Bancos divisas en moneda extranjera	274,707	105,202			
Dólares americanos	5,922	4,134			
Euros	92	12,802			
Yenes	268,693	88,266			
Divisas por recibir	70	133,339			
Dólares americanos	70	133,339			
Divisas por entregar		68,322			
Dólares americanos		68,322			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	4,989,628	4,266,694			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	320,418,814	368,427,502			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	16,072,073	7,981,412			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	19,132,589	38,369,593			
Contratos Adelantados sobre Euros	783,336	1,301,989			
Contratos Futuros sobre Renta Fija (Tasas)	595,613	12,641,187			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Extranjera	461,627	377,279			
Ctos.Opc./Rta.Variable Nac.	3,526	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	103,461,484	103,799,451			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	23,593,745	36,886,379			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	4,553,155	4,682,066			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	118,897,368	109,304,179			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	29,912,513	52,887,531			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	2,951,785	196,436			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	298,972,386	362,220,156			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	390,200	223,533			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	11,715,410	36,579,154			
Contratos Adelantados sobre Euros	740,289	5,813,175			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	774,940	1,213,201			
Contratos Futuros de Renta Variable Nacional	1,131,765	225,187			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	696,212	10,162,481			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	112,369,856	102,566,924			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	31,425,941	52,040,961			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	8,628,273	9,559,927			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	3,770,247	1,018,901			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	102,006,140	104,937,620			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	25,323,113	37,879,092			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$ 6,736,282	\$ 7,249,549
Un valor de los activos netos de:	\$ 159,999,813	\$ 150,571,629
El precio de la acción de:	\$ 10.073027	\$ 9.495532

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

ESTADOS DE RESULTADOS INTEGRAL POR LOS PERIODOS DEL 1 DE ENERO AL 31 DE MARZO DE 2018 Y 2017

(Cifras en miles de pesos)

	2018	2017
Ingresos por la venta de Valores	13,695,472	24,035,392
Intereses, dividendos, premios y derechos	2,320,362	2,014,587
Resultado cambiario / Otros productos	(135,228)	33,137
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	(37,026)	1,868,470
INGRESOS NETOS	15,843,580	27,951,586
Costo de ventas de valores	13,514,472	24,000,587
Gastos generales	26,565	20,959
Comisiones sobre saldos	399,181	375,501
Comisiones por servicios de tercerización	4,970	674
Intereses sobre inversiones en valores a entregar	82,253	140,104
EGRESOS NETOS	14,027,441	24,537,825
UTILIDAD DE OPERACIÓN	1,816,139	3,413,761
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(1,329,492)	1,740,177
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	486,647	5,153,938

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 28 de Febrero de 2018, fueron aprobados los Estados Financieros al 31 de Diciembre de 2017, asimismo, los presentes Estados Financieros al 31 de Marzo de 2018 serán aprobados en la Sesión del Consejo de Administración que se llevará a cabo el próximo 23 de Mayo de 2018.