

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 31 DE MARZO DE 2019 Y 2018

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2019	2018	PASIVO	2019	2018
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	11	11	Divisas por entregar	794,494	1,355
Bancos monedas extranjeras	811,368	167,146	Acreedores	1,123,318	269,312
Divisas por recibir	40,100	1,580	Provisiones para gastos	22,179	30,353
	851,479	168,737	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	5,162,507	5,377,810
INVERSIONES			TOTAL PASIVO	7,102,498	5,678,830
Inversión en valores de renta variable	22,980,053	19,307,871			
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	1,322,915	2,173,659			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	75,850,812	68,282,991			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	6,518,767	4,807,748			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	51,425,595	46,666,499			
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(2,163,269)	(1,881,691)			
Inversiones tercerizadas	3,250,938	3,250,938			
Plus (Minus) valía en Inversiones tercerizadas	633,075	171,030			
Depósito Traspaso Banxico	414,466	302,821			
Plus (Minus) valía en inversión en el Depósito Traspaso Banxico	2,178	4,446			
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	8,281,672	10,219,906			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	673,173	387,633			
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	2,649,171	2,559,574			
Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	(53,937)	68,480			
Inversión en FIBRAS	6,494,417	5,972,581			
Plus (Minus) valía en Inversion en FIBRAS	(1,155,273)	(908,608)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	15,993	12,123			
Inversión en valores extranjeros de deuda	518,916	656,864			
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	(15,470)	44,218			
Inversión en títulos Fiduciarios	9,498,602	6,915,951			
Plus (minus) valía en Títulos Fiduciarios	2,314,849	1,999,167			
Inversión en instrumentos de deuda por reporto	6,398,113	6,258,847			
Plus (Minus) valía de valores por reporto	20,229	11,960			
Valores Prestados	10,103,721	4,253,869			
Plus (Minus) valía de valores prestados	340,088	11,613			
	206,319,794	181,550,490			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	992,167	517,585			
Dividendos o derechos por cobrar	8,571	39,242			
Intereses devengados sobre valores	2,050,653	1,922,002			
Reportos	(20,245)	(11,414)			
Premios por cobrar por préstamo de valores	474	273			
Intereses devengados por instrumentos recibidos en reporto	5,921	34,561			
Intereses devengados sobre valores prestados	156,372	72,401			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	3,397,746	4,241,849			
	6,591,659	6,816,499			
TOTAL ACTIVO	213,762,932	188,535,726			
			CAPITAL CONTABLE	2019	2018
			CAPITAL		
			CAPITAL CONTRIBUIDO	84,135,662	70,743,680
			Capital social pagado	20,471,482	19,080,742
			Prima en venta de acciones	63,664,180	51,662,938
			CAPITAL GANADO	114,107,675	105,235,520
			Resultados de ejercicios anteriores	110,415,764	103,012,585
			Resultados del ejercicio	3,691,911	2,222,935
			OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
			PLUS (MINUS) VALÍAS	8,417,097	6,877,696
			TOTAL CAPITAL CONTABLE	206,660,434	182,856,896
			TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	213,762,932	188,535,726

CUENTAS DE ORDEN	2019	2018	CUENTAS DE ORDEN	2019	2018
Valores entregados en custodia	188,802,451	170,259,678	Capital social autorizado	27,500,100	27,500,100
Valores entregados en custodia por reporto	6,404,017	6,293,954	Acciones emitidas	27,500,100,000	27,500,100,000
Valores prestados	10,443,809	4,265,482	Acciones en circulación, posición propia	151,659,526	141,568,802
Garantías recibidas por valores prestados	11,220,232	4,590,313	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	20,319,822,230	18,939,172,805
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	462,983	66,115			
Bancos divisas en moneda extranjera	58,333	275,468			
Dólares americanos	40,719	6,545			
Euros	893	72			
Yenes	16,721	268,851			
Divisas por recibir	2,069	86			
Dólares americanos	2,069	86			
Divisas por entregar	41,000	74			
Dólares americanos	41,000	74			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	8,560,488	4,632,299			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	315,259,359	304,107,253			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	13,221,125	13,660,277			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	22,535,883	23,066,506			
Contratos Adelantados sobre Euros	2,598,474	828,912			
Contratos de Futuros sobre Renta Variable Extranjera	58,676	133,418			
Contratos de Opciones sobre Renta Variable Nacional	3,101	3,511			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	94,600,467	87,776,850			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	34,212,873	24,513,228			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	3,250,080	3,669,358			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	2,247,090				
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	103,619,544	109,547,181			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	35,593,724	37,589,690			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	3,318,322	3,318,322			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	297,983,064	286,084,967			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	3,115,628	381,623			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	16,194,921	14,838,673			
Contratos Adelantados sobre Euros	370,096	1,281,231			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas		675,758			
Contratos de Futuros de Renta Variable Nacional	999,280	1,619,833			
Contratos de Futuros sobre Dólar Americano	309,853	794,547			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	98,695,654	103,857,994			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	39,423,261	39,911,603			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	5,049,284	6,978,834			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	4,296,034	4,208,145			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	92,139,709	85,942,958			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	35,142,254	25,593,768			
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:	\$ 8,417,097	\$ 6,877,696
Un valor de los activos netos de:	\$ 206,660,434	\$ 182,856,896
El precio de la acción de:	\$ 10.095040	\$ 9.583322

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 31 DE MARZO DE 2019 Y 2018

(Cifras en miles de pesos)

	2019	2018
Ingresos por la venta de Valores	12,445,905	15,122,913
Intereses, dividendos, premios y derechos	2,538,993	2,595,909
Resultado cambiario / Otros productos	(57,729)	(99,948)
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	1,492,851	(20,987)
INGRESOS NETOS	16,420,020	17,597,887
Costo de ventas de valores	12,110,201	14,770,832
Gastos generales	52,783	29,143
Comisiones sobre saldos	483,582	455,977
Comisiones por servicios de tercerización	4,857	4,621
Intereses sobre inversiones en valores a entregar	76,686	114,379
EGRESOS NETOS	12,728,109	15,374,952
UTILIDAD DE OPERACIÓN	3,691,911	2,222,935
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	6,712,083	(1,722,076)
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	10,403,994	500,859

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.

NOTA A LOS ESTADOS FINANCIEROS:

En la Sesión del Consejo de Administración con fecha 13 de Febrero de 2019, fueron aprobados los Estados Financieros al 31 de Diciembre de 2018, asimismo, los presentes Estados Financieros al 31 de Marzo de 2019 serán aprobados en la Sesión del Consejo de Administración que se llevará a cabo el próximo 28 de mayo de 2019.