

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 2018 Y 2017

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2018	2017	PASIVO	2018	2017
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	11	2,681	Acreedores	269,312	2,302,423
Bancos monedas extranjeras	167,146	1,771,478	Divisas por entregar	1,355	1,665,450
Divisas por recibir	1,580	1,165,143	Provisiones para gastos	30,353	14,416
	168,737	2,939,302	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	5,377,810	6,577,374
INVERSIONES			TOTAL PASIVO	5,678,830	10,559,663
Inversión en valores de renta variable	19,307,871	18,818,839			
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	2,173,659	4,459,837			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	68,282,991	48,005,137			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	4,807,748	4,034,687			
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	46,666,499	44,615,988			
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	(1,881,691)	(1,729,689)			
Inversiones tercerizadas	3,250,938	2,214,871			
Plus (Minus) valía en Inversiones tercerizadas	171,030	(25,466)			
Depósito Traspaso Banxico	302,821	367,358			
Plus (Minus) valía en inversión en el Depósito Traspaso Banxico	4,446	10,708			
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	10,219,906	8,607,328			
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	387,633	713,976			
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	2,559,574	1,471,508			
Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	68,480	42,259			
Inversión en FIBRAS	5,972,581	4,463,802			
Plus (Minus) valía en Inversion en FIBRAS	(908,608)	(368,875)			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	12,123	47,911			
Inversión en valores extranjeros de deuda	656,864	2,207,584			
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	44,218	13,515			
Inversión en títulos Fiduciarios	6,915,951	5,323,597			
Plus (minus) valía en Títulos Fiduciarios	1,999,167	1,642,338			
Inversión en instrumentos de deuda por reporto	6,258,847	10,791,542			
Plus (Minus) valía de valores por reporto	11,960	(13,611)			
Valores Prestados	4,253,869	735,367			
Plus (Minus) valía de valores prestados	11,613	(15,296)			
	181,550,490	156,435,215			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	517,585	1,842,110			
Dividendos o derechos por cobrar	39,242	6,626			
Intereses devengados sobre valores	1,922,002	1,601,154			
Reportos	(11,414)	13,742			
Premios por cobrar por préstamo de valores	273	19			
Intereses devengados por instrumentos recibidos en reporto	34,561	49,754			
Intereses devengados sobre valores prestados	72,401	9,297			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	4,241,849	6,673,171			
	6,816,499	10,195,873			
TOTAL ACTIVO	188,535,726	169,570,390			
			CAPITAL CONTABLE	2018	2017
			CAPITAL		
			CAPITAL CONTRIBUIDO	70,743,680	56,939,799
			Capital social pagado	19,080,742	17,572,353
			Prima en venta de acciones	51,662,938	39,367,446
			CAPITAL GANADO	105,235,520	93,292,934
			Resultados de ejercicios anteriores	103,012,585	89,628,668
			Resultados del ejercicio	2,222,935	3,664,266
			OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
			PLUS (MINUS) VALÍAS	6,877,696	8,777,994
			TOTAL CAPITAL CONTABLE	182,856,896	159,010,727
			TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	188,535,726	169,570,390

Cuentas de Orden	2018	2017	Cuentas de Orden	2018	2017
Valores entregados en custodia	170,259,678	144,889,301	Capital social autorizado	27,500,100	27,500,100
Valores entregados en custodia por reporto	6,293,954	10,841,427	Acciones emitidas	27,500,100,000	27,500,100,000
Valores prestados	4,265,482	720,072	Acciones en circulación, posición propia	141,568,802	128,451,857
Garantías recibidas por préstamo de valores	4,590,313	774,060	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	18,939,172,805	17,443,900,575
Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	66,115	209,090			
Bancos divisas en moneda extranjera	275,468	693,941			
Dólares americanos	6,545	77,758			
Euros	72	10,362			
Yenes	268,851	605,821			
Divisas por recibir	86	61,991			
Dólares americanos	86	61,991			
Divisas por entregar	74	88,609			
Dólares americanos	74	88,609			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	4,632,299	3,634,141			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	304,107,253	319,022,421			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	13,660,277	3,939,029			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	23,066,506	34,441,525			
Contratos Adelantados sobre Euros	828,912	1,284,792			
Contratos Futuros sobre Renta Fija (Tasas)		6,418,711			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Extranjera	133,418	-			
Ctos.Opc./Rta.Variable Nac.	3,511	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	87,776,850	84,111,084			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	24,513,228	37,146,443			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	3,669,358	3,822,545			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	109,547,181	94,867,769			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	37,589,690	52,863,105			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Euros	3,318,322	127,418			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	286,084,967	325,178,379			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	381,623	1,110,728			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	14,838,673	33,313,919			
Contratos Adelantados sobre Euros	1,281,231	5,465,834			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	675,758	948,023			
Contratos Futuros de Renta Variable Nacional	1,619,833	204,715			
Contratos Futuros de Renta Variable Extranjera		569,090			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	794,547	10,572,161			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	103,857,994	89,403,288			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	39,911,603	52,363,629			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	6,978,834	7,598,616			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	4,208,145	970,088			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	85,942,958	85,259,270			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	25,593,768	37,399,018			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$	6,877,696	\$	8,777,994
Un valor de los activos netos de:	\$	182,856,896	\$	159,010,727
El precio de la acción de:	\$	9.583322	\$	9.048915

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 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 2018 Y 2017

(Cifras en miles de pesos)

	2018	2017
Ingresos por la venta de Valores	15,122,913	24,168,730
Intereses, dividendos, premios y derechos	2,595,909	2,093,896
Resultado cambiario / Otros productos	(99,948)	(74,803)
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	(20,987)	1,712,849
INGRESOS NETOS	17,597,887	27,900,672
Costo de ventas de valores	14,770,832	23,666,693
Gastos generales	29,143	20,599
Comisiones sobre saldos	455,977	399,611
Comisiones por servicios de tercerización	4,621	613
Intereses sobre inversiones en valores a entregar	114,379	148,890
EGRESOS NETOS	15,374,952	24,236,406
UTILIDAD DE OPERACIÓN	2,222,935	3,664,266
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(1,722,076)	1,267,396
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	500,859	4,931,662

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.