



# Profuturo®

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

## FONDO PROFUTURO SB2, S.A. DE C.V., SIEFORE, SOCIEDAD DE INVERSIÓN ESPECIALIZADA DE FONDOS PARA EL RETIRO

TIPO DE SIEFORE: Básica 1 ( ) Básica 2 (x) Básica 3 ( ) Básica 4 ( ) Básica de Pensiones ( ) Corto Plazo ( ) Largo Plazo ( ) Previsión Social ( )

### ESTADO DE SITUACIÓN FINANCIERA AL 31 DE DICIEMBRE DE:

(Cifras en miles de pesos)

	2017	2016		2017	2016
<b>ACTIVO</b>			<b>PASIVO</b>		
<b>DISPONIBLE</b>			<b>OBLIGACIONES</b>		
Bancos moneda nacional	2,287,734	1,700,632	Divisas por entregar	74,984	942,810
Bancos monedas extranjeras	429,858	620,053	Acreedores	56,529	83,627
Divisas por recibir	-	322,954	Provisiones para gastos	20,151	12,404
	<b>2,717,632</b>	<b>2,643,639</b>			
<b>INVERSIONES</b>			<b>TOTAL PASIVO</b>	<b>151,664</b>	<b>1,038,841</b>
Inversión en valores de renta variable	27,194,082	20,046,239			
Plus (Minus) valías en Valores de Renta Variable	9,981,649	6,624,464			
Inversión en Instrumentos de deuda nacional de tasa real denominados en pesos y USD	55,800,232	38,267,983			
Plus (Minus) valías en instrumentos de deuda nacional de tasa real denominados en pesos y USD	6,350,740	3,649,572			
Inversión en Instrumentos de Deuda Nacional de Tasa Nominal Denominados en Pesos	66,122,735	64,340,364	<b>CAPITAL CONTABLE</b>		
Plus (Minus) valías en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal denominados en pesos	-2,215,588	-2,698,933			
Deposito traspaso Bancario	1,181,494	1,500,389	<b>CAPITAL</b>		
Plus (Minus) valías en inversión en el Depósito Traspaso Bancario	320	389			
Inversión en Instrumentos de deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	286,878	533,173	Capital contribuido	<b>91,594,272</b>	<b>71,646,989</b>
Plus (Minus) valías en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	141,598	228,150	Capital social pagado	19,723,582	17,341,846
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	1,089,207	677,397	Prima en venta de acciones	71,870,690	54,305,143
Operaciones derivadas	-11,522	10,373			
Inversión en Fibras	2,375,764	1,592,792	Capital ganado	<b>73,389,830</b>	<b>64,259,864</b>
Plus (Minus) valías en Inversión en Fibras	-162,149	-245,739	Resultados de ejercicios anteriores	64,259,864	58,356,020
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	473,320	473,225	Resultado del ejercicio	9,129,966	5,903,844
Inversión en Valores Extranjeros de Deuda	1,894,662	2,145,282			
Plus (Minus) valías en Inversión en valores extranjeros de deuda	175,230	187,112	Otros Resultados Integrales		
Inversión en títulos Fiduciarios	5,307,307	3,891,872	Plus (Minus) valías	<b>15,456,249</b>	<b>8,708,142</b>
Plus (minus) valías en Títulos Fiduciarios	1,158,071	972,754			
	<b>177,157,880</b>	<b>142,176,837</b>	<b>TOTAL CAPITAL CONTABLE</b>	<b>180,440,351</b>	<b>144,614,995</b>
<b>DEUDORES DIVERSOS</b>			<b>TOTAL PASIVO Y CAPITAL</b>	<b>180,592,015</b>	<b>145,653,836</b>
Liquidadora	-	65,955			
Dividendos o derechos por cobrar	41,809	3,111			
Intereses devengados sobre valores	674,684	584,594			
	<b>716,593</b>	<b>653,660</b>			
<b>TOTAL ACTIVO</b>	<b>180,592,015</b>	<b>145,653,836</b>			

### CUENTAS DE ORDEN

Valores entregados en custodia	176,678,548	141,703,612	Capital social autorizado	1,000,000,100	1,000,000,100
Garantías Recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	3,860	-	Acciones emitidas	1,000,000,100,000	1,000,000,100,000
Bancos divisas en moneda extranjera	22,029	39,810	Acciones en circulación posición propia	147,067,143	129,634,117
Dólares americanos	21,269	39,655	Acciones de Señores, Posición de Terrosos	1	1
Otras Divisas	820	150	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	15,576,515,002	17,212,211,693
Dólar canadiense	820	155			
Divisas por recibir	-	15,663			
Dólares americanos	-	15,663			
Divisas por entregar	3,813	45,724			
Dólares americanos	3,813	45,724			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	7,413,295	4,330,878			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición Larga	10,786,139	5,897,492			
Contratos Futuros sobre Renta Fija (Bonos)	3,673,337	2,728,576			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	62,269	34,215			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Extranjera	5,740,187	2,385,748			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	1,313,604	748,953			
Contratos de Opciones sobre Renta Variable Nacional	743	-			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición Corta	26,531,502	21,860,841			
Contratos Futuros sobre Renta Fija (Bonos)	1,035,520	4,845,947			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	11,101,840	8,475,570			
Contratos Futuros sobre Euros	6,454,588	5,396,533			
Contratos Futuros sobre Yenes	2,144,811	1,946,371			
Contratos Futuros sobre Otras Divisas	1,794,743	1,196,420			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$ 15,456,249	\$ 8,708,142
Un valor de los activos netos de:	\$ 180,440,351	\$ 144,614,995
El precio de la acción de:	\$ 9.148457	\$ 8.339077

MARTHA BARRERA FERNÁNDEZ

Contador General SIEFORE

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

ARTURO GARCÍA RODRÍGUEZ

Director General

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

GUILLERMO BABATZ GARCÍA

Comisario

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. Los presentes estados financieros fueron aprobados por el consejo de administración de fecha 20 de febrero de 2018

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

## FONDO PROFUTURO SB2, S.A. DE C.V., SIEFORE, SOCIEDAD DE INVERSIÓN ESPECIALIZADA DE FONDOS PARA EL RETIRO

TIPO DE SIEFORE: Básica 1 ( ) Básica 2 (x) Básica 3 ( ) Básica 4 ( ) Básica de Pensiones ( ) Corto Plazo ( ) Largo Plazo ( ) Previsión Social ( )

### ESTADO DE RESULTADOS INTEGRAL

(Cifras en miles de pesos)

Por los periodos al 31 de Diciembre de:

	2017	2016
Ingresos por la venta de valores	92,312,367	50,694,778
Intereses, dividendos, premios y derechos	6,612,414	5,292,022
Resultado cambiario / Otros productos	-47,452	270,268
Resultados por Intermediación con Instrumentos Financieros Derivados	1,296,056	-326,157
<b>Ingresos Netos</b>	<b>100,133,375</b>	<b>55,928,911</b>
Costo de ventas de valores	89,351,844	48,612,723
Gastos generales	24,896	25,922
Comisiones sobre saldos	1,626,669	1,386,422
<b>Egresos netos</b>	<b>91,003,409</b>	<b>50,025,067</b>
<b>Utilidad de operación</b>	<b>9,129,966</b>	<b>5,903,844</b>
<b>Otros Resultados Integrales</b>		
Plus (Minus) Valías	6,748,107	2,428,337
<b>UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO</b>	<b>15,878,073</b>	<b>8,332,181</b>

MARTHA BARRERA FERNÁNDEZ

Contador General SIEFORE

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

ARTURO GARCÍA RODRÍGUEZ

Director General

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

GUILLERMO BABATZ GARCÍA

Comisario

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

El presente estado financiero se formuló de conformidad con 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. Los presentes estados financieros fueron aprobados por el consejo de administración de fecha 20 de febrero de 2018