



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 MARZO DE:

(Cifras en miles de pesos)

	2018	2017		2018	2017
ACTIVO			PASIVO		
DISPONIBLE			OBLIGACIONES	69,377	1,613,540
Bancos moneda nacional	1,096,298	2,185,407	Divisas por entregar	-	10,883
Bancos monedas extranjeras	320,720	552,853	Acreedores	43,671	1,589,909
Divisas por recibir	-	-	Provisiones para gastos	25,705	12,749
	1,417,018	2,738,260			
RESERVADOS			TOTAL PASIVO	69,377	1,613,540
Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en MN	-	918,187			
Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en divisas	-	1,233,614			
	-	1,041,801			
INVERSIONES			CAPITAL CONTABLE		
Inversión en valores de renta variable	27,363,829	21,933,916			
Plus (Minus) valia en valores de renta variable	6,298,518	5,848,749			
Inversión en instrumentos de deuda nacional de tasa real denominados en pesos y USD	59,321,232	39,899,928			
Plus (Minus) valia en instrumentos de deuda nacional de tasa real denominados en pesos y USD	6,302,988	4,683,175			
Inversión en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal denominados en pesos	67,381,379	63,865,736			
Plus (Minus) valia en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal denominados en pesos	-1,279,407	-1,664,412	CAPITAL CONTRIBUIDO	95,163,539	73,267,595
Deposito Traspaso Bancario	1,186,628	1,506,829	Capital social pagado	20,112,564	17,532,131
Plus (Minus) valia en inversión en el Deposito Traspaso Bancario	17,423	43,922	Prima en venta de acciones	75,050,975	55,735,464
Inversión en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	286,877	533,173			
Plus (Minus) valia en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	107,802	177,351	CAPITAL GANADO	76,085,737	67,119,235
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	1,089,207	1,384,985	Resultados de ejercicios anteriores	73,389,827	64,259,864
Plus (Minus) valia en instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	5,792	-43,822	Resultado del ejercicio	2,696,910	2,859,371
Inversión en FIBRAS	4,364,321	1,143,597			
Plus (Minus) valia en Inversión en FIBRAS	-197,441	-156,639	OTROS RESULTADOS INTEGRALES	12,897,072	10,103,412
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	543,890	424,174			
Inversión en valores extranjeros de deuda	1,639,046	2,145,282			
Plus (Minus) valia en inversión en valores extranjeros de deuda	189,209	183,640	PLUS (MINUS) VALIAS	12,897,072	10,103,412
Inversión en Títulos Fiduciarios	5,222,474	3,903,697			
Plus (minus) valia en Títulos Fiduciarios	1,451,828	1,051,108			
	181,295,954	146,624,731			
DEUDORES DIVERSOS			TOTAL CAPITAL CONTABLE	184,146,348	150,490,242
Liquidadora	8,341	366,613			
Dividendos o derechos por cobrar	19,247	6,777			
Intereses devengados sobre valores	1,474,164	1,125,601			
	1,502,752	1,498,991			
TOTAL ACTIVOS	184,215,724	152,103,782	TOTAL PASIVO Y CAPITAL	184,215,724	152,103,782

CUENTAS DE ORDEN

Valores entregados en custodia	180,752,065	146,400,557	Capital social autorizado	1,000,000,100	1,000,000,100
Garantías Recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	4,150	-	Acciones emitidas	1,000,000,100,000	1,000,000,100,000
Bancos divisas en moneda extranjera	17,778	29,492	Acciones en circulación posición propia	149,016,947	130,020,221
Dolares americanos	16,776	29,181	Acciones de Siefores, posición de terceros	1	1
Euro	-	-	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	19,963,547,073	17,402,110,861
Otras Divisas	1,002	311			
Dólar Canadiense	1,002	311			
Depositos reservados al pago de compromisos futuros en moneda extranjera	-	6,577			
Divisas por entregar	-	579			
Compromisos futuros por la adquisición de Títulos Fiduciarios	7,279,654	4,255,376			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición Larga	9,568,383	6,138,533			
Contratos Futuros sobre Renta Fija (Bonos)	3,157,888	3,399,127			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	52,109	35,941			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Extranjera	6,397,643	1,042,948			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	-	1,661,416			
Contratos de Opciones sobre Renta Variable Nacional	743	-			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición Corta	25,567,636	25,063,590			
Contratos Futuros sobre Renta Fija (Bonos)	4,173,459	4,766,015			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	11,384,095	10,923,897			
Contratos Futuros sobre Euros	6,649,004	5,921,309			
Contratos Futuros sobre Yenes	1,694,235	2,136,192			
Contratos Futuros sobre Otras Divisas	1,666,844	1,316,176			
La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:					
Una plus (minus) valia de:	\$ 12,897,072	\$ 10,103,412			
Un valor de los activos netos de:	\$ 184,146,348	\$ 150,490,242			
El precio de la acción de:	\$ 9.155787	\$ 8.583682			

MARTHA BARRERA FERNÁNDEZ

Contador General de 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

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 17 de Abril 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 Marzo de:

	2018	2017
Ingresos por la venta de valores	22,322,080	11,756,256
Intereses, Dividendos, Premios y Derechos	1,925,084	1,488,657
Resultado cambiario / Otros productos	-87,104	-79,027
Resultados por Intermediación con Instrumentos Financieros Derivados	716,781	1,377,300
Ingresos Netos	24,896,841	14,543,186
Costo de Ventas de Valores	21,737,852	11,298,676
Gastos Generales	5,775	7,145
Comisiones Sobre Saldos	457,305	377,994
Egresos Netos	22,200,931	11,683,815
UTILIDAD DE OPERACIÓN	2,695,910	2,859,371
Otros Resultados Integrales		
Plus (Minus) valias	-2,558,216	1,395,269
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	137,694	4,254,640

MARTHA BARRERA FERNÁNDEZ

Contador General de 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

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 17 de Abril de 2018