



# 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 30 DE SEPTIEMBRE DE:

(Cifras en miles de pesos)

	2018	2017		2018	2017
<b>ACTIVO</b>			<b>PASIVO</b>		
<b>DISPONIBLE</b>			<b>OBLIGACIONES</b>	<b>1,616,967</b>	<b>56,912</b>
Bancos moneda nacional	2,398,865	2,685,474	Acreeedores	1,600,332	43,115
Bancos monedas extranjeras	887,658	437,479	Provisiones para gastos	16,636	13,798
	<b>3,286,524</b>	<b>3,122,953</b>			
<b>INVERSIONES</b>			<b>TOTAL PASIVO</b>	<b>1,616,967</b>	<b>56,912</b>
Inversión en valores de renta variable	28,257,815	25,909,867			
Plus (Minus) valia en valores de renta variable	6,323,052	7,329,466			
Inversión en instrumentos de deuda nacional de tasa real denominados en pesos y UDIS	64,819,191	52,350,650			
Plus (Minus) valia en instrumentos de deuda nacional de tasa real denominados en pesos y UDIS	6,918,434	6,108,508			
Inversión en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal denominados en pesos	73,577,730	56,880,071	<b>CAPITAL CONTABLE</b>		
Plus (Minus) valia en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal denominados en pesos	-1,448,139	-951,186			
Inversión en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	286,877	286,877	<b>CAPITAL CONTRIBUIDO</b>	<b>101,695,400</b>	<b>78,828,448</b>
Plus (Minus) valia en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	94,752	104,182	Capital Social pagado	20,807,962	18,164,746
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	1,145,515	1,089,207	Prima en venta de acciones	80,887,438	60,663,703
Plus (Minus) valia en instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	141,572	14,402			
Inversión en FIBRAS	4,619,950	1,748,503	<b>CAPITAL GANADO</b>	<b>83,071,579</b>	<b>70,761,851</b>
Plus (Minus) valia en Inversión en FIBRAS	-243,513	-112,525	Resultados de ejercicios anteriores	73,389,827	64,259,864
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	461,891	269,448	Resultado del ejercicio	9,681,752	6,501,987
Inversión en valores extranjeros de deuda	940,337	1,942,443			
Plus (Minus) valia en inversión en valores extranjeros de deuda	6,116,896	4,761,606	<b>OTROS RESULTADOS INTEGRALES</b>	<b>13,397,163</b>	<b>13,740,549</b>
Inversión en Títulos Fiduciarios	1,428,834	1,041,428			
Plus (minus) valia en Títulos Fiduciarios	<b>193,632,335</b>	<b>158,979,221</b>	<b>PLUS (MINUS) VALÍAS</b>	<b>13,397,163</b>	<b>13,740,549</b>
<b>DEUDORES DIVERSOS</b>			<b>TOTAL CAPITAL CONTABLE</b>	<b>198,164,142</b>	<b>163,330,848</b>
Liquidadora	1,315,530	-			
Dividendos o derechos por cobrar	70,848	46,187			
Intereses devengados sobre valores	1,475,571	1,285,587	<b>TOTAL PASIVO Y CAPITAL</b>	<b>199,781,109</b>	<b>163,387,761</b>
	<b>2,862,250</b>				
<b>TOTAL ACTIVOS</b>	<b>199,781,109</b>	<b>163,387,761</b>			

### CUENTAS DE ORDEN

Valores entregados en custodia	193,170,474	158,709,773	Capital social autorizado	1,000,000,100	1,000,000,100
Garantías Recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	2,773	3,089	Acciones emitidas	1,000,000,100,000	1,000,000,100,000
Bancos divisas en moneda extranjera	48,360	24,220	Acciones en circulación posición propia	152,826,831	134,581,018
Dolares americanos	43,712	23,578	Acciones de Siefores, posición de terceros	1	1
Euro	266	-	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	20,655,134,794	18,030,164,777
Otras Divisas	4,382	642			
Dólar Canadiense					
Compromisos futuros por la adquisición de Títulos fiduciarios	4,382	642			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición Larga	6,977,758	5,797,524			
Contratos Futuros sobre Renta Fija (Bonos)	10,200,803	6,475,916			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	2,683,709	3,501,602			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Extranjera	53,747	37,898			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	6,186,891	1,776,942			
Contratos de Opciones sobre Renta Variable Nacional	1,325,712	1,159,632			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición Corta	743	743			
Contratos Futuros sobre Renta Fija (Bonos)	17,668,798	24,908,991			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	2,573,402	4,664,276			
Contratos Futuros sobre Euros	7,891,945	11,805,201			
Contratos Futuros sobre Yenes	3,793,483	5,206,781			
Contratos Futuros sobre Otras Divisas	1,648,261	1,762,444			
	1,959,676	1,470,309			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valia de:	\$ 13,397,163	\$ 13,740,549
Un valor de los activos netos de:	\$ 198,164,142	\$ 163,330,848
El precio de la acción de:	\$ 9.523477	\$ 8.991640

**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 18 de Octubre de 2018

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

## FONDO PROFUTURO SB2, S.A. DE C.V., 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 30 de Septiembre de:

	2018	2017
Ingresos por la venta de valores	90,358,867	59,301,496
Intereses, Dividendos, Premios y Derechos	6,007,117	4,519,191
Resultado cambiario / Otros productos	-113,910	-87,049
Resultados por Intermediación con Instrumentos Financieros Derivados	2,185,192	1,802,762
<b>Ingresos Netos</b>	<b>98,437,267</b>	<b>65,536,400</b>
Costo de Ventas de Valores	87,303,789	57,836,935
Gastos Generales	20,108	18,132
Comisiones Sobre Saldos	1,431,618	1,179,346
<b>Egresos Netos</b>	<b>88,755,515</b>	<b>59,034,413</b>
<b>UTILIDAD DE OPERACIÓN</b>	<b>9,681,752</b>	<b>6,501,987</b>
<b>Otros Resultados Integrales</b>		
Plus (Minus) valias	-2,059,087	5,032,406
<b>UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO</b>	<b>7,622,665</b>	<b>11,534,393</b>

**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 18 de Octubre de 2018