



Profuturo®

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO FONDO PROFUTURO SB3, S.A. DE C.V., SIEFORE, SOCIEDAD DE INVERSIÓN ESPECIALIZADA DE FONDOS PARA EL RETIRO

TIPO DE SIEFORE: Básica 1 () Básica 2 () Básica 3 (x) 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 |
|--|--------------------|--------------------|-------------------------------------|--------------------|--------------------|
| ACTIVO | | | PASIVO | | |
| DISPONIBLE | | | OBLIGACIONES | | |
| Bancos moneda nacional | 2,549,569 | 1,478,803 | Divisas por entregar | 92,846 | 521,191 |
| Bancos monedas extranjeras | 755,705 | 616,759 | Acreedores | 51,544 | 64,151 |
| Divisas por recibir | - | 324,148 | Provisiones para gastos | 17,594 | 11,433 |
| | 3,305,274 | 2,419,750 | | | |
| INVERSIONES | | | TOTAL PASIVO | 161,984 | 596,775 |
| Inversión en valores de renta variable | 24,219,295 | 20,354,530 | | | |
| Plus (Minus) valías en Valores de Renta Variable | 6,422,405 | 5,913,257 | | | |
| Inversión en instrumentos de deuda nacional de tasa real denominados en pesos y UDIS | 48,617,329 | 37,179,846 | | | |
| Plus (Minus) valías en instrumentos de deuda nacional de tasa real denominados en pesos y UDIS | 7,093,907 | 4,793,173 | | | |
| Inversión en Instrumentos de Deuda Nacional de Tasa Nominal Denominados en Pesos | 52,671,734 | 49,975,759 | | | |
| Plus (Minus) valías en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal denominados en pesos | -1,317,002 | -1,887,570 | | | |
| Depósito traspaso Bancario | 7,589 | 10,201 | | | |
| Plus (Minus) valías en inversión en el Depósito Traspaso Bancario | 2 | 3 | | | |
| Inversión en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso | 307,682 | 565,681 | CAPITAL CONTABLE | | |
| Plus (Minus) valías en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso | 155,218 | 247,888 | Capital contribuido | 94,691,755 | 84,088,359 |
| Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas | 936,522 | 1,654,606 | Capital social pagado | 77,739,125 | 72,213,580 |
| Plus (Minus) valías en instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas | 83,401 | 6,853 | Prima en venta de acciones | 16,952,630 | 11,874,779 |
| Inversión en Fibras | 1,989,163 | 1,744,028 | | | |
| Plus (Minus) valías en Inversión en Fibras | -140,032 | -291,351 | Capital ganado | 45,820,896 | 37,401,948 |
| Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados | 571,410 | 583,521 | Resultados de ejercicios anteriores | 37,401,948 | 31,380,470 |
| Inversión en Valores Extranjeros de Deuda | 1,565,688 | 1,948,869 | Resultado del ejercicio | 8,418,948 | 6,021,478 |
| Plus (Minus) valías en inversión en valores extranjeros de deuda | 162,777 | 600,526 | | | |
| Inversión en Títulos Fiduciarios | 5,876,748 | 5,099,472 | Otros Resultados Integrales | | |
| Plus (minus) valías en Títulos Fiduciarios | 1,513,361 | 1,443,174 | Plus (Minus) valías | 15,974,037 | 10,396,354 |
| | 152,734,597 | 129,522,966 | | | |
| DEUDORES DIVERSOS | | | TOTAL CAPITAL CONTABLE | 156,486,688 | 131,886,660 |
| Liquidadora | - | 42,295 | | | |
| Dividendos e derechos por cobrar | 56,292 | 4,231 | TOTAL PASIVO Y CAPITAL | 156,648,672 | 132,483,435 |
| Intereses devengados sobre valores | 552,599 | 494,183 | | | |
| | 608,891 | 540,719 | | | |
| TOTAL ACTIVO | 156,648,672 | 132,483,435 | | | |

CUENTAS DE ORDEN

| | | | | | |
|---|-------------|-------------|---|-----------------|-----------------|
| Valores entregados en custodia | 152,163,097 | 128,929,345 | Capital social autorizado | 1,000,000,100 | 1,000,000,100 |
| Garantías recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC) | 3,582 | - | Acciones emitidas | 208,233,011,885 | 208,233,011,885 |
| Bancos divisas en moneda extranjera | 36,619 | 29,959 | Acciones en circulación posición propia | 119,556,555 | 110,038,707 |
| Dólares americanos | 37,698 | 29,781 | Acciones de Siefiores, Posición de Terceros | 1 | 1 |
| Otras Divisas | 921 | 178 | Acciones en circulación propiedad de los trabajadores | 16,068,294,009 | 14,927,211,123 |
| Dólar canadiense | 921 | 178 | | | |
| Divisas por recibir | - | 15,721 | | | |
| Dólares americanos | - | 15,721 | | | |
| Dólares americanos | 4,722 | 25,277 | | | |
| Dólares americanos | 4,722 | 25,277 | | | |
| Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios | 7,661,425 | 5,050,732 | | | |
| Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición Larga | 14,349,758 | 8,466,929 | | | |
| Contratos Futuros sobre Renta Fija (Bonos) | 3,227,235 | 2,381,635 | | | |
| Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional | 139,711 | 145,065 | | | |
| Contratos Futuros sobre Renta Variable Extranjera | 10,478,023 | 5,574,710 | | | |
| Contratos Futuros sobre Dólar Americano | 178,109 | 39,419 | | | |
| Contratos de Opciones sobre Renta Variable Nacional | 689 | - | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos | 326,000 | 326,000 | | | |
| Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición Corta | 21,936,058 | 21,873,540 | | | |
| Contratos Futuros sobre Renta Fija (Bonos) | 4,396,449 | 4,426,839 | | | |
| Contratos Futuros sobre Dólar Americano | 8,076,118 | 7,424,289 | | | |
| Contratos Futuros sobre Euro | 6,366,948 | 6,022,510 | | | |
| Contratos Futuros sobre Venes | 836,283 | 2,088,319 | | | |
| Contratos Futuros sobre Otras Divisas | 1,934,260 | 1,545,583 | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos | 326,000 | 326,000 | | | |

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de: \$ 15,974,037 \$ 10,396,353
 Un valor de los activos netos de: \$ 156,486,688 \$ 131,886,660
 El precio de la acción de: \$ 9,666,927 \$ 8,770,664

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

GUILLELMO 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 SB3, S.A. DE C.V., SIEFORE, SOCIEDAD DE INVERSIÓN ESPECIALIZADA DE FONDOS PARA EL RETIRO

TIPO DE SIEFORE: Básica 1 () Básica 2 () Básica 3 (x) 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 | 85,595,297 | 49,630,455 |
| Intereses, dividendos, premios y derechos | 5,738,361 | 4,874,689 |
| Resultado cambiario / Otros productos | -5,178 | 274,848 |
| Resultados por intermediación con Instrumentos Financieros Derivados | 1,711,932 | -190,534 |
| Ingresos Netos | 93,040,412 | 54,589,458 |
| Costo de ventas de valores | 83,109,877 | 47,227,273 |
| Gastos Generales | 26,162 | 32,480 |
| Comisiones sobre saldos | 1,485,425 | 1,308,227 |
| Egresos netos | 84,621,464 | 48,567,980 |
| Utilidad de operación | 8,418,948 | 6,021,478 |
| Otros Resultados Integrales | | |
| Plus (Minus) Valías | 5,577,684 | 2,221,677 |
| UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO | 13,996,632 | 8,243,155 |

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

GUILLELMO 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