



Profuturo®

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

**FONDO PROFUTURO SB1, S.A. DE C.V., SIEFORE,
SOCIEDAD DE INVERSIÓN ESPECIALIZADA DE FONDOS PARA EL RETIRO**

TIPO DE SIEFORE: Básica 1 (x) Básica 2 () 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)

| | 2017 | 2016 | | 2017 | 2016 |
|---|-------------------|-------------------|-------------------------------------|-------------------|-------------------|
| ACTIVO | | | PASIVO | | |
| DISPONIBLE | | | OBLIGACIONES | | |
| Bancos moneda nacional | 223,293 | 384,342 | Divisas por entregar | 869 | 2,436 |
| Bancos monedas extranjeras | 19,656 | 53,736 | Acreedores | 391 | 1,257 |
| | 242,949 | 438,078 | Provisiones para gastos | 994 | 399 |
| INVERSIONES | | | TOTAL PASIVO | 2,254 | 4,092 |
| Inversión en valores de renta variable | 319,659 | 377,167 | | | |
| Plus (Minus) valías en Valores de Renta Variable | 91,035 | 95,666 | | | |
| Inversión en instrumentos de deuda nacional de tasa real denominados en pesos y UDIS | 5,867,994 | 5,976,399 | | | |
| Plus (Minus) valía en instrumentos de deuda nacional de tasa real denominados en pesos y UDIS | 785,620 | 836,678 | | | |
| Inversión en Instrumentos de Deuda Nacional de Tasa Nominal Denominados en Pesos | 3,533,971 | 4,748,182 | CAPITAL CONTABLE | | |
| Plus (Minus) valía en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal denominados en pesos | -128,825 | -3,732 | CAPITAL | | |
| Depósito traspaso Bancario | - | 5,287 | Capital contribuido | 4,288,301 | 6,618,013 |
| Plus (Minus) valía en inversión en el Depósito Traspaso Bancario | - | 61 | Capital social pagado | 5,274,605 | 6,358,908 |
| Inversión en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso | 73,649 | 73,649 | Prima en venta de acciones | -1,006,304 | 259,106 |
| Plus (Minus) valía en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso | 24,173 | 17,046 | | | |
| Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas | 176,620 | 167,507 | Capital ganado | 6,650,860 | 5,989,304 |
| Plus (Minus) valía en instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas | -8,653 | -467 | Resultados de ejercicios anteriores | 6,492,743 | 5,901,605 |
| Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados | 13,681 | 679,750 | Resultado del ejercicio | 158,117 | 87,899 |
| Plus (Minus) valía en Instrumentos Financieros Derivados Listados | 43,871 | 66,534 | | | |
| Valores Prestados | - | 4,216 | Otros resultados integrales | | |
| Plus (Minus) valía de valores prestados | - | -103 | | | |
| | 11,389,012 | 13,067,535 | Plus (Minus) valías | 807,221 | 1,011,684 |
| DEUDORES DIVERSOS | | | TOTAL CAPITAL CONTABLE | 11,726,381 | 13,619,002 |
| Liquidadora | 25 | 724 | | | |
| Dividendos o derechos por cobrar | 124 | 58 | TOTAL PASIVO Y CAPITAL | 11,728,635 | 13,623,093 |
| Intereses devengados sobre valores | 116,524 | 116,612 | | | |
| Intereses devengados sobre valores prestados | - | 86 | | | |
| | 116,674 | 117,480 | | | |
| TOTAL ACTIVO | 11,728,635 | 13,623,093 | | | |

CUENTAS DE ORDEN

| | | | | | |
|---|------------|------------|---|-------------------|-------------------|
| Valores entregados en custodia | 11,355,331 | 13,039,220 | Capital social autorizado | 3,333,598,100 | 3,333,598,100 |
| Valores Prestados | - | 4,114 | Acciones emitidas | 1,000,000,029,998 | 1,000,000,029,998 |
| Garantías recibidas por valores prestados | - | 4,487 | Acciones en circulación posición propia | 13,256,637 | 16,042,727 |
| Bancos divisas en moneda extranjera | 1,048 | 3,119 | Acciones de Siefores, Posición de Terceros | 1 | 1 |
| Divisas americanas | 1,040 | 3,111 | Acciones en circulación propiedad de los trabajadores | 1,568,999,310 | 1,891,478,151 |
| Otras Divisas | 7 | 8 | | | |
| Dólar canadiense | 7 | 8 | | | |
| Divisas por entregar | 46 | 141 | | | |
| Dólares americanos | 46 | 141 | | | |
| Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición Larga | 229,703 | 352,922 | | | |
| Contratos Futuros sobre Renta Variable Extranjera | 65,786 | 129,913 | | | |
| Contratos Futuros sobre Dólar Americano | 44,917 | 104,009 | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos | 119,000 | 119,000 | | | |
| Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición Corta | 976,459 | 1,214,796 | | | |
| Contratos Futuros sobre Renta Fija (Bonos) | 402,052 | 657,029 | | | |
| Contratos Futuros sobre Dólar Americano | 260,368 | 218,452 | | | |
| Contratos Futuros sobre Euros | 124,436 | 128,120 | | | |
| Contratos Futuros sobre Yenes | 42,815 | 43,130 | | | |
| Contratos Futuros sobre Otras Divisas | 27,788 | 49,065 | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos | 119,000 | 119,000 | | | |

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

| | | |
|-----------------------------------|---------------|---------------|
| Una plus (minus) valía de: | \$ 807,221 | \$ 1,011,684 |
| Un valor de los activos netos de: | \$ 11,726,381 | \$ 13,619,002 |
| El precio de la acción de: | \$ 7.411178 | \$ 7.139634 |

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

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 24 de abril de 2017

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

**FONDO PROFUTURO SB1, S.A. DE C.V.,
SOCIEDAD DE INVERSIÓN ESPECIALIZADA DE FONDOS PARA EL RETIRO**

TIPO DE SIEFORE: Básica 1 (x) Básica 2 () 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:

| | 2017 | 2016 |
|--|----------------|------------------|
| Ingreso por la venta de valores | 598,244 | 1,405,828 |
| Intereses, dividendos, premios y derechos | 132,253 | 133,134 |
| Resultados cambiarios / Otros productos | -3,045 | 1,843 |
| Resultados por Intermediación con Instrumentos Financieros Derivados | 36,733 | -32,827 |
| Ingresos Netos | 764,185 | 1,507,979 |
| Costo de ventas de valores | 575,198 | 1,385,163 |
| Gastos generales | 304 | 365 |
| Comisiones sobre saldos | 30,566 | 34,722 |
| Egresos netos | 606,068 | 1,420,280 |
| Utilidad de operación | 158,117 | 87,699 |
| Otros Resultados Integrales | | |
| Plus (Minus) Valías | 38,910 | 251,018 |
| UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO | 197,027 | 338,716 |

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

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 24 de abril de 2017