



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 JUNIO DE:

(Cifras en miles de pesos)

	2017	2016		2017	2016
ACTIVO			PASIVO		
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	1,859,225	1,256,185	Divisas por entregar	77,965	70,942
Bancos monedas extranjeras	237,690	792,532	Acreedores	860,095	315,667
Divisas por recibir	228,218	-	Provisiones para gastos	13,241	3,745
	<u>2,325,134</u>	<u>2,048,717</u>			
RESERVADOS			TOTAL PASIVO	<u>951,301</u>	<u>390,354</u>
Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en moneda extranjera	1,685	-			
	<u>1,685</u>	<u>-</u>			
INVERSIONES			CAPITAL CONTABLE		
Inversión en valores de renta variable	25,313,475	16,897,337	CAPITAL		
Plus (Minus) valías en Valores de Renta Variable	5,879,442	4,704,689	Capital contribuido	75,660,605	59,398,104
Inversión en instrumentos de deuda nacional de tasa real denominados en pesos y UDIs	43,581,537	33,892,181	Capital social pagado	17,808,450	15,749,699
Plus (Minus) valía en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal denominados en pesos y UDIs	5,563,383	3,593,849	Prima en venta de acciones	57,852,155	43,648,405
Inversión en Instrumentos de Deuda Nacional de Tasa Nominal Denominados en Pesos	64,016,013	57,478,311	Capital ganado	<u>69,011,522</u>	<u>59,793,041</u>
Plus (Minus) valía en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal denominados en pesos	-983,924	84,552	Resultados de ejercicios anteriores	64,259,864	58,356,021
Inversión en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	533,173	480,698	Resultado del ejercicio	4,751,658	1,437,020
Plus (Minus) valía en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	163,672	162,811	Otros Resultados Integrales		
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	1,199,235	930,636	Plus (Minus) valías	<u>11,684,829</u>	<u>9,413,893</u>
Plus (Minus) valía en instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	42,233	33,697			
Inversión en Fibras	1,213,933	1,170,505	TOTAL CAPITAL CONTABLE	<u>156,356,955</u>	<u>128,605,038</u>
Plus (Minus) valía en Inversión en Fibras	-88,261	-39,416			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	314,915	1,140,947			
Inversión en Valores Extranjeros de Deuda	2,030,553	2,070,344			
Plus (Minus) valía en inversión en valores extranjeros de deuda	203,587	245,583			
Inversión en Títulos Fiduciarios	4,339,347	3,000,693			
Plus (minus) valía en Títulos Fiduciarios	669,163	626,128			
	<u>154,218,011</u>	<u>126,476,145</u>			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	190,371	-			
Dividendos o derechos por cobrar	8,624	2,594			
Intereses devengados sobre valores	564,431	467,937			
	<u>763,426</u>	<u>470,530</u>			
TOTAL ACTIVO	<u>157,308,256</u>	<u>128,995,392</u>	TOTAL PASIVO Y CAPITAL	<u>157,308,256</u>	<u>128,995,392</u>

CUENTAS DE ORDEN

Valores entregados en custodia	153,903,096	125,335,198	Capital social autorizado	1,000,000,100	1,000,000,100
Bancos divisas en moneda extranjera	13,268	43,045	Acciones emitidas	1,000,000,100,000	1,000,000,100,000
Dólares americanos	12,796	42,508	Acciones en circulación posición propia	132,484,179	118,045,219
Otras Divisas	471	537	Acciones de Siéforos, Posición de Terceros	1	1
Dólar canadiense	471	537	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	17,675,965,407	15,631,653,792
Divisas por recibir	12,635	-			
Dólares americanos	12,635	-			
Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en divisas, moneda extranjera	93	-			
Dólares americanos	93	-			
Divisas por entregar	4,316	3,842			
Dólares americanos	4,316	3,842			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	4,868,798	2,981,058			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición Larga	6,595,274	8,260,037			
Contratos Futuros sobre Renta Fija (Bonos)	3,568,121	-			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	37,245	19,432			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Extranjera	1,507,482	6,858,580			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	1,482,426	1,382,026			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición Corta	25,466,535	23,177,702			
Contratos Futuros sobre Renta Fija (Bonos)	4,856,548	6,326,860			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	13,081,167	6,869,892			
Contratos Futuros sobre Euros	4,240,495	5,921,726			
Contratos Futuros sobre Yenes	1,949,562	2,084,717			
Contratos Futuros sobre Otras Divisas	1,338,763	2,374,508			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$ 11,684,829	\$ 9,413,893
Un valor de los activos netos de:	\$ 156,356,955	\$ 128,605,038
El precio de la acción de:	\$ 8.779931	\$ 8.165555

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 25 de julio de 2017

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 Junio de:

	2017	2016
Ingresos por la venta de Valores	35,832,288	20,620,348
Intereses, dividendos, premios y derechos	3,067,745	2,592,912
Resultado cambiario / Otros productos	-92,511	76,977
Resultados por Intermediación con Instrumentos Financieros Derivados	1,753,167	-967,248
Ingresos Netos	<u>40,560,688</u>	<u>22,322,990</u>
Costo de ventas de valores	35,024,137	20,221,310
Gastos generales	14,219	11,552
Comisiones sobre saldos	770,674	653,107
Egresos netos	<u>35,809,030</u>	<u>20,885,970</u>
Utilidad de operación	<u>4,751,658</u>	<u>1,437,020</u>
Otros Resultados Integrales		
Plus (Minus) Valías	2,976,686	3,134,088
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	<u>7,728,344</u>	<u>4,571,108</u>

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 25 de julio de 2017