



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)

	2017	2016		2017	2016
ACTIVO			PASIVO		
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	2,185,407	3,208,742	Divisas por entregar	10,883	52,893
Bancos monedas extranjeras	552,853	825,125	Acreedores	1,589,909	606,848
	2,738,260	4,033,868	Provisiones para gastos	12,749	3,690
RESERVADOS					
Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en MN	918,187	-			
Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en moneda extranjera	123,614	-			
	1,041,801	-			
INVERSIONES			TOTAL PASIVO	1,613,540	663,431
Inversión en valores de renta variable	21,933,916	16,621,896			
Plus (Minus) valías en Valores de Renta Variable	5,846,749	3,966,075			
Inversión en instrumentos de deuda nacional de tasa real denominados en pesos y UDIS	39,899,928	37,176,283			
Plus (Minus) valía en instrumentos de deuda nacional de tasa real denominados en pesos y UDIS	4,683,175	3,126,705			
Inversión en instrumentos de Deuda Nacional de Tasa Nominal Denominados en Pesos	63,865,736	46,018,521	CAPITAL CONTABLE		
Plus (Minus) valía en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal denominados en pesos	-1,664,412	-69,675	CAPITAL		
Depósito Traspaso Bancario	1,508,629	2,458,914	Capital contribuido	73,267,595	59,865,085
Plus (Minus) valía en inversión en el Depósito Traspaso Bancario	43,922	28,546	Capital social pagado	17,532,131	15,708,277
Inversión en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	533,173	480,698	Prima en venta de acciones	55,735,464	43,356,809
Plus (Minus) valía en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	177,351	101,961			
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	1,364,585	892,586	Capital ganado	67,119,235	58,779,511
Plus (Minus) valía en instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	-43,482	24,335	Resultados de ejercicios anteriores	64,259,864	58,356,021
Inversión en Fibras	1,143,597	1,102,945	Resultado del ejercicio	2,859,371	423,490
Plus (Minus) valía en Inversión en Fibras	-156,639	-3,411			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	424,174	680,540	Otros Resultados Integrales		
Inversión en Valores Extranjeros de Deuda	2,145,282	2,070,944	Plus (Minus) valías	10,103,412	7,988,850
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	183,640	252,354			
Inversión en Títulos Fiduciarios	3,903,667	2,931,663			
Plus (minus) valía en Títulos Fiduciarios	1,051,108	573,421			
Valores Prestados	-	273,323			
Plus (Minus) valía de valores prestados	-	-1,460			
	146,824,731	120,687,493	TOTAL CAPITAL CONTABLE	150,490,242	125,843,446
DEUDORES DIVERSOS			TOTAL PASIVO Y CAPITAL	152,103,782	126,506,877
Liquidadora	366,613	793,910			
Dividendos o derechos por cobrar	6,777	2,401			
Intereses devengados sobre valores	1,125,001	995,025			
Premios por cobrar por préstamo de valores	-	4			
Intereses devengados sobre valores prestados	1,498,991	4,177			
	1,498,991	1,785,517			
TOTAL ACTIVO	152,103,782	126,506,877			

CUENTAS DE ORDEN

Valores entregados en custodia	146,400,557	119,755,090	Capital social autorizado	1,000,000,100	1,000,000,100
Valores Prestados	-	271,863	Acciones emitidas	1,000,000,100,000	1,000,000,100,000
Garantías recibidas por valores prestados	-	295,112	Acciones en circulación posición propia	130,020,221	118,387,610
Bancos divisas en moneda extranjera	29,492	47,960	Acciones de Siefores, Posición de Terceros	1	1
Dólares americanos	29,181	47,559	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	17,402,110,861	15,589,889,231
Otras Divisas	311	401			
Dólar canadiense	311	401			
Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en divisas, moneda extranjera	6,577	-			
Dólares americanos	6,577	-			
Divisas por entregar	579	3,069			
Dólares americanos	579	3,069			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	4,255,378	3,075,089			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición Larga	6,138,533	7,776,991			
Contratos Futuros sobre Renta Fija (Bonos)	3,399,127	-			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	35,941	120,060			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Extranjera	1,042,048	7,054,515			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	1,661,416	602,117			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición Corta	25,063,589	23,597,549			
Contratos Futuros sobre Renta Fija (Bonos)	4,766,015	6,289,393			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	10,923,897	7,449,871			
Contratos Futuros sobre Euros	5,921,309	5,625,819			
Contratos Futuros sobre Yenes	2,136,192	2,080,810			
Contratos Futuros sobre Otras Divisas	1,316,176	2,151,856			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:
 Una plus (minus) valía de: \$ 10,103,412 \$ 7,988,850
 Un valor de los activos netos de: \$ 150,490,242 \$ 125,843,446
 El precio de la acción de: \$ 6.583682 \$ 8.011283

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 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 31 de Marzo de:

	2017	2016
Ingresos por la venta de Valores	11,756,256	10,814,355
Intereses, dividendos, premios y derechos	1,488,657	1,189,931
Resultado cambiario / Otros productos	-79,027	-29,589
Resultados por Intermediación con Instrumentos Financieros Derivados	1,377,300	-615,660
	14,543,186	11,359,036
Ingresos Netos	14,543,186	11,359,036
Costo de ventas de valores	11,298,676	10,615,163
Gastos generales	7,145	4,965
Comisiones sobre saldos	377,394	315,399
	11,683,515	10,935,547
Egresos netos	11,683,515	10,935,547
Utilidad de operación	2,859,371	423,490
Otros Resultados Integrales		
Plus (Minus) Valías	1,395,269	1,719,045
	4,254,640	2,142,535
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	4,254,640	2,142,535

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