

AKAAN TRANSAMERICA 2 S.A. DE C.V.
Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda
Administrado por Akaan Transamerica, S. A. de C. V., Sociedad Operadora de Fondos de Inversión
(AKTMXCP)
AVENIDA SANTA FE NO. 440, PISO 21
C.P. 05348 MEXICO D.F.
DEL. CUAJIMALPA DE MORELOS
BALANCE GENERAL
Al 31 de Marzo de 2018

100000	ACTIVO			PASIVO	
110000	DISPONIBILIDADES			ACREEDORES POR REPORTE	
111000	Caja			PRESTAMO DE VALORES	
112000	Bancos			Premios a Entregar	
113000	DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTIA			COLATERALES VENDIDOS O DADOS EN GARANTIA	
113010	Compraventa de Divisas			REPORTOS	
113020	Prestamo de Valores			OBLIGACION DE LA REPORTADORA POR RETITUCION DEL COLATERAL	
113030	Otras Disponibilidades Restringidas o dadas en garantía			COLATERALES VENDIDOS	
120000	CUENTAS DE MARGEN			Deuda gubernamental	
121000	Efectivo			Deuda bancaria	
122000	Valores			Otros títulos de deuda	
123000	Otros Activos			COLATERALES DADOS EN GARANTIA	
130000	INVERSIONES EN VALORES			PRESTAMO DE VALORES	
131000	Títulos para negociar	6,149,924.00		OBLIGACION DEL PRESTATARIO POR RESTITUCION DEL COLATERAL	
131100	Títulos para negociar sin restricción	6,149,924.00		COLATERALES VENDIDOS	
131110	Deuda gubernamental	2,144,684.00		Deuda gubernamental	
131120	Deuda bancaria	98,964.00		Deuda bancaria	
131130	Otros títulos de deuda	3,906,276.00		Otros títulos de deuda	
131140	Instrumentos de patrimonio neto			Instrumentos de patrimonio Neto	
131400	TIT. P/ neg restringidos o dados en gta. en op. de reporte			OBLIGACION DEL PRESTAMISTA POR RESTITUCION DEL COLATERAL	
131410	Deuda gubernamental			COLATERALES VENDIDOS	
131420	Deuda bancaria			Deuda gubernamental	
131430	Otros títulos de deuda			Deuda bancaria	
131440	Instrumentos de patrimonio neto			Otros títulos de deuda	
131200	TIT. P/ neg restringidos o dados en gta. en op. de prestamo d			Instrumentos de patrimonio Neto	
131210	Deuda gubernamental			DERIVADOS	
131220	Deuda bancaria			COLATERALES VENDIDOS	
131230	Otros títulos de deuda			Deuda gubernamental	
131240	Instrumentos de patrimonio neto			Deuda bancaria	
131300	TIT. P/ neg restringidos o dados en gta. (otros)			Otros títulos de deuda	
131310	Deuda gubernamental			Instrumentos de patrimonio Neto	
131320	Deuda bancaria			Otros	
131330	Otros títulos de deuda			OTROS COLATERALES VENDIDOS	
131340	Instrumentos de patrimonio neto			DERIVADOS	
140100	DEUDORES POR REPORTE	1,145,900.00		CON FINES DE NEGOCIACION	
140200	PRESTAMO DE VALORES			Futuros a entregar	
140210	Premios a recibir			Contratos adelantados a entregar	
151000	DERIVADOS			Opciones	
151100	CON FINES DE NEGOCIACION			Swaps	
151110	Futuros a recibir			Paquetes de instrumentos derivados	
151120	Contratos adelantados a recibir			CON FINES DE COBERTURA	
151130	Opciones			Futuros a entregar	
151140	Swaps			Contratos adelantados a entregar	
151150	Paquetes de instrumentos derivados			Opciones	
151200	CON FINES DE COBERTURA			Swaps	
151210	Futuros a recibir			Paquetes de instrumentos derivados	
151220	Contratos adelantados a recibir			AJUSTES DE VALUACION POR COBERTURA DE PASIVOS FINANCIEROS	
151230	Opciones			OTRAS CUENTAS POR PAGAR	8,739.00
151240	Swaps			IMPUESTO A LA UTILIDAD POR PAGAR	3,294.00
151250	Paquetes de instrumentos derivados			Impuestos a la utilidad (pagos provisionales)	3,294.00
152000	AJUSTES DE VALUACION POR COBERTURA DE ACTIVOS			Impuestos a la utilidad (calculo real)	
160000	CUENTAS POR COBRAR	2.00		APORT. P/FUTUROS AUMENTOS DE CAPITAL PEND. DE FORMALIZAR	
160100	DEUDORES POR LIQUIDACION DE OPERACIONES	2.00		ACREEDORES POR LIQUIDACION DE OPERACIONES	
160110	Acciones Propias			Acciones Propias	
160120	Compraventa de divisas			Compraventa de divisas	
160130	Inversion en valores	2.00		Inversion en valores	
160140	Reportos			Reportos	
160150	Prestamo de valores			Prestamo de valores	
160160	Derivados			Derivados	
160200	DEUDORES POR CUENTAS DE MARGEN			ACREEDORES POR CUENTAS DE MARGEN	
166000	DEUDORES POR COLATERALES OTORGADOS EN EFECTIVO			ACREEDORES POR COLATERALES RECIBIDOS EN EFECTIVO	
160300	DEUDORES DIVERSOS			ACREEDORES DIVERSOS Y OTRAS CUANTAS POR PAGAR	5,445.00
160310	PREMIOS, COMISIONES Y DERECHOS POR COBRAR			Comisiones por pagar sobre operaciones vigentes	
160320	DIVIDENDOS POR COBRAR			Acreeedores por adquisicion de activos	
160330	SALDOS A FAVOR DE IMPUESTOS E IMPUESTOS AC			Dividendos por pagar	
160350	OTROS DEUDORES			Otros impuestos y derechos	
310800	ESTIMACION POR IRRECUPERABILIDAD O DIFICIL COBRO			PROVISIONES PARA OBLIGACIONES DIVERSAS	5,445.00
170100	BIENES ADJUDICADOS			Remuneraciones y prestaciones a consejeros	
170110	BIENES MUEBLES, VALORES Y DERECHOS ADJUDICAD			Honorarios	
170120	MUEBLES ADJUDICADOS RESTRINGIDOS			Rentas	
170130	INMUEBLES ADJUDICADOS			Gastos de promocion y publicidad	
170140	INMUEBLES ADJUDICADOS RESTRINGIDOS			Gastos en tecnologia	
170200	PROPIEDADES, MOBILIARIO Y EQUIPO			Otras provisiones	5,445.00
170210	PROPIEDADES, MOBILIARIO Y EQUIPO			OTROS ACREEDORES DIVERSOS	
310100	DEPRECIACION ACUMULADA DE PROPIEDADES, MOBILIARIO Y EQUIPO			IMPUESTOS DIFERIDOS (A CARGO)	
139100	INVERSIONES PERMANENTES EN ACCIONES DE EMPRESA			CREDITOS DIFERIDOS Y COBROS ANTICIPADOS	
180000	IMPUESTOS DIFERIDOS (A FAVOR)			CREDITOS DIFERIDOS	
190000	OTROS ACTIVOS			COBROS ANTICIPADOS	
191000	CARGOS DIFERIDOS, PAGOS ANTICIPADOS E INTANGIBLES			Cobros ant. de bienes prom. en venta o con rva. de dominio	
191100	CARGOS DIFERIDOS			Otros cobros anticipados	
191120	Seguros por amortizar			TOTAL DE PASIVO	8,739.00
				CAPITAL CONTABLE	
				CAPITAL CONTRIBUIDO	7,149,047.00
				CAPITAL SOCIAL	7,099,113.00
				MINIMO FIJO	1,000,000.00
				VARIABLE	6,099,113.00
				CAPITAL SOCIAL NO EXHIBIDO	
				APORT. P/FUTUROS AUMENTOS DE CAPITAL FORMALIZADAS	
				PRIMA EN VENTA DE ACCIONES	49,934.00

191130	Otros cargos diferidos				
191200	PAGOS ANTICIPADOS			CAPITAL GANADO	138,040.00
191210	Intereses pagados por anticipado			RESERVAS DE CAPITAL	
191220	Comisiones pagadas por anticipado			RESERVA POR ADQUISICION DE ACCIONES PROPIAS	
191230	Anticipos o pagos provisionales de impuestos			RESULTADO DE EJERCICIOS ANTERIORES	13,554.00
191240	Rentas pagadas por anticipado			Resultado por aplicar	13,554.00
191250	Otros pagos anticipados			Resultado por cambios contables y corr. de errores	
191300	INTANGIBLES			RESULTADO POR VALUACION DE INST. DE COB. DE FLUJO DE EFECTIVO	
191310	Credito mercantil			Valuacion	
191320	Otros intangibles			Efecto de impuestos a la utilidad diferidos	
310300	Amortizacion acumulada de otros intangibles			Estim. por impuestos a la util. Diferidos no recuperables	
192000	OTROS ACTIVOS A CORTO Y LARGO PLAZO			RES. POR VALUAC. DE INV. PERMANENTES EN ACCS. DE EMP. PROM.	
				RESULTADO NETO	124,486.00
				TOTAL CAPITAL CONTABLE	7,287,087.00
100099	TOTAL DEL ACTIVO	7,295,826.00		TOTAL PASIVO Y CAPITAL CONTABLE	7,295,826.00
	CUENTAS DE ORDEN				
	ACTIVOS Y PASIVOS CONTINGENTES				
	CAPITAL SOCIAL AUTORIZADO	200,001,000,000.00			
	ACCIONES EMITIDAS	200,001,000,000.00			
	COLATERALES RECIBIDOS POR LA ENTIDAD	1,145,909.00			
	EFECTIVO ADMINISTRADO EN FIDEICOMISO				
	DEUDA GUBERNAMENTAL	1,145,909.00			
	DEUDA BANCARIA				
	OTROS TITULOS DE DEUDA				
	INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO				
	OTROS				
	COLATERALES RECIBIDOS Y VENDIDOS O ENTREGADOS EN GARANTIA POR LA ENT.				
	DEUDA GUBERNAMENTAL				
	DEUDA BANCARIA				
	OTROS TITULOS DE DEUDA				
	INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO				
	OTROS				
	OTRAS CUENTAS DE REGISTRO				

Ver notas adjuntas a los estados financieros.

"El presente estado de valuación de cartera de inversión se formuló de conformidad con los criterios de contabilidad para Fondos de Inversión, emitidos por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores con fundamento en lo dispuesto por el artículo 76 de la Ley de Fondos de Inversión, de observancia general y obligatoria, aplicados de manera consistente, encontrándose reflejadas las operaciones con activos objetos de inversión efectuadas por el Fondo hasta la fecha arriba mencionada, las cuales se realizaron y valoraron con apego a sanas prácticas y a las disposiciones legales y administrativas aplicables.

El presente estado de valuación de cartera de inversión fue aprobado por el Consejo de Administración de Akaan Transamerica, S. A. de C. V., Sociedad Operadora de Fondos de Inversión, bajo la responsabilidad de los directivos que lo suscriben."

Carlos Vallebuena Garcinava
Director General de la Operadora

Narah Figueroa Hernández
Contralor Normativo

AKAAN TRANSAMERICA 2 S.A. DE C.V.
Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda
Administrado por Akaan Transamerica, S. A. de C. V., Sociedad Operadora de Fondos de Inversión
(AKTMXCP)
AVENIDA SANTA FE NO. 440, PISO 21
C.P. 05348 MEXICO D.F.
DEL. CUAJIMALPA DE MORELOS
Estado de Resultados
Al 31 de Marzo de 2018

511000	RESULTADO POR VALUACION A VALOR RAZONABLE	9,097.00
511100	RESULTADO POR VALUACION A VALOR RAZONABLE	9,097.00
511110	TITULOS PARA NEGOCIAR	9,097.00
512000	RESULTADO POR COMPRAVENTA	-
512100	RESULTADO POR COMPRAVENTA DE VALORES Y DERIVADOS	-
512110	Titulos para negociar	- 1,492.00
513000	RESULTADO POR PARTICIPACION EN ACCIONES DE EMPRESAS PROMOVIDAS	
514000	INGRESOS POR INTERESES	139,003.00
514300	INTERESES Y RENDIMIENTOS A FAVOR PROVENIENTES DE INVERSIONES EN VALORES	101,524.00
514310	Titulos para negociar	101,524.00
514400	INTERESES Y RENDIMIENTOS A FAVOR EN OPERACIONES DE REPORTO	37,479.00
515000	OTROS INGRESOS DE LA OPERACION	
510099	TOTAL DE INGRESOS DE LA OPERACION	146,608.00
521000	SERVICIOS ADMINISTRATIVOS Y DE DISTRIBUCION PAGADOS A LA SOCIEDAD OPERADORA	11,806.00
521001	ADMINISTRACION DE ACTIVOS	11,806.00
521020	Fondos propios	11,806.00
521030	Por cuenta de terceros	
522000	SERVICIOS ADMINISTRATIVOS Y DE DISTRIBUCION PAGADOS A OTRAS ENTIDADES	
523000	GASTOS POR INTERESES	
524000	OTROS EGRESOS DE LA OPERACION	
525000	GASTOS DE ADMINISTRACION	10,316.00
525005	IMPUESTOS Y DERECHOS DIVERSOS	10,316.00
520099	TOTAL DE EGRESOS DE LA OPERACION	22,122.00
540092	UTILIDAD (PERDIDA) BRUTA	124,486.00
527000	IMPUESTOS A LA UTILIDAD CAUSADOS	
528000	IMPUESTOS A LA UTILIDAD DIFERIDOS	
528100	IMPUESTOS A LA UTILIDAD DIFERIDOS	
528200	ESTIMACION POR IMPUESTOS A LA UTILIDAD NO RECUPERABLE	
540093	RESULTADO ANTES DE OPERACIONES DISCONTINUADAS	124,486.00
530000	OPERACIONES DISCONTINUADAS	
540099	RESULTADO NETO	124,486.00

Ver notas adjuntas a los estados financieros.

"El presente estado de valuación de cartera de inversión se formuló de conformidad con los criterios de contabilidad para Fondos de Inversión, emitidos por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores con fundamento en lo dispuesto por el artículo 76 de la Ley de Fondos de Inversión, de observancia general y obligatoria, aplicados de manera consistente, encontrándose reflejadas las operaciones con activos objetos de inversión efectuadas por el Fondo hasta la fecha arriba mencionada, las cuales se realizaron y valoraron con apego a sanas prácticas y a las disposiciones legales y administrativas aplicables.

El presente estado de valuación de cartera de inversión fue aprobado por el Consejo de Administración de Akaan Transamerica, S. A. de C. V., Sociedad

Carlos Vallebuena Garcinava
Director General de la Operadora

Narah Figueroa Hernández
Contralor Normativo

Akaan Transamerica 2, S. A de C. V.
Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda
Administrado por Akaan Transamerica, S. A. de C. V., Sociedad Operadora de Fondos de Inversión
Avenida Santa Fe 440 , Piso 21, Santa Fe Cuajimalpa, México

Estado de Valuación de Cartera de Inversión

31 de marzo de 2018

(Miles de pesos, excepto costos promedios unitarios de adquisición y valores razonables o contables unitarios)

<u>%</u>	<u>Emisora</u>	<u>Serie</u>	<u>Tipo de Valor</u>	<u>Tasa al valor (%)</u>	<u>Calificación o bursatilidad</u>	<u>Días por vencer</u>	<u>Cantidad de títulos operados</u>	<u>Cantidad de títulos liquidados</u>	<u>Total de títulos de la emisión</u>	<u>Costo promedio unitario de adquisición</u>	<u>Costo total de adquisición</u>	<u>Valor razonable o contable unitario</u>	<u>Valor razonable o contable total</u>
46.3724	301 Valores Gubernamentales												
	CETES	180426	BI	7.40325	-	24	25,400	25,400	7,797,690,951 \$	9.770856	248,180	9.950645	252,746
	BPAG28	180517	IM	7.51	-	45	8,000	8,000	130,000,000 \$	100.212016	801,696	100.219889	801,759
	BONDES	180419	LD	7.55	-	17	1,000	1,000	280,315,536 \$	100.208590	100,209	100.230694	100,231
	BONDES	181011	LD	7.55	-	192	5,500	5,500	411,499,622 \$	100.050842	550,280	100.070794	550,389
	BONDES	181213	LD	7.56	-	255	500	500	423,429,418 \$	100.455900	50,228	100.480054	50,240
	BONDES	191003	LD	7.55	-	549	2,000	2,000	369,580,019 \$	100.022350	200,045	100.076259	200,153
	BONOS	181213	M	8.5	-	255	600	600	1,469,024,589 \$	103.332600	62,000	103.190781	61,914
	BONOS	191211	M	5	-	618	1,300	1,300	2,272,032,950 \$	96.877569	125,941	97.885936	127,252
1.04678	302 Títulos Bancarios												
	BACOMER	10	94	7.83	AAA(mex)	875	1,000	1,000	10,777,141 \$	97.872880	97,873	98.963789	98,964
40.6287	303 Papel Privado												
	BNPPPF	15	91	8.23	AAA(mex)	263	1,100	1,100	11,000,000 \$	100.525509	110,578	100.493588	110,543
	CATFIN	14	91	8.04	mxAAA	157	336	336	1,428,574 \$	100.200595	33,667	100.189473	33,664
	FSHOP	15	91	8.73	AA(mex)	812	2,000	2,000	30,000,000 \$	100.674980	201,350	100.679311	201,359
	HOLCIM	14	91	8.22	AAA(mex)	53	6,610	6,610	20,000,000 \$	100.725461	665,795	100.718988	665,753
	PCARFM	15	91	8.19	AAA(mex)	409	4,678	4,678	10,000,000 \$	100.206274	468,765	100.214763	468,805
	SORIANA	15	91	8.39	AA+(mex)	997	3,000	3,000	71,000,000 \$	100.393537	301,181	100.468850	301,407
	VWLEASE	14-2	91	8.13	mxAAA	179	716	716	25,000,000 \$	100.361788	71,859	100.366940	71,863
	VWLEASE	15	91	8.23	mxAAA	445	2,000	2,000	15,000,000 \$	100.635225	201,270	100.638718	201,277
	CFE	13	95	7.98	Aa1.mx	81	5,973	5,973	152,500,000 \$	100.713447	601,561	100.721060	601,607
	FEFA	17-4	95	8.08	AAA(mex)	813	3,500	3,500	32,200,000 \$	100.730797	352,558	100.729731	352,554
	FEFA	17-5	95	8.28	AAA(mex)	1541	1,000	1,000	20,240,000 \$	100.995380	100,995	101.161486	101,161
	PEMEX	14-2	95	7.47	Aa3.mx	3146	900	900	314,013,888 \$	89.830889	80,848	92.005114	82,805
	PEMEX	16	95	9.18	Aa3.mx	548	7,000	7,000	50,000,000 \$	101.992653	713,949	101.925659	713,480
11.9521	402 Reportador												
	BONDES	180705	LD	7.59	-	-	11,418	11,418	209,767,139 \$	100.253405	1,144,693	100.359089	1,145,900
	Cartera total							95,531			\$ 7,285,521		\$ 7,295,826

Ver notas adjuntas a los estados financieros.

"El presente estado de valuación de cartera de inversión se formuló de conformidad con los criterios de contabilidad para Fondos de Inversión, emitidos por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores con fundamento en lo dispuesto por el artículo 76 de la Ley de Fondos de Inversión, de observancia general y obligatoria, aplicados de manera consistente, encontrándose reflejadas las operaciones con activos objetos de inversión efectuadas por el Fondo hasta la fecha arriba mencionada, las cuales se realizaron y valoraron con apego a sanas prácticas y a las disposiciones legales y administrativas aplicables.

El presente estado de valuación de cartera de inversión fue aprobado por el Consejo de Administración de Akaan Transamerica, S. A. de C. V., Sociedad Operadora de Fondos de Inversión, bajo la responsabilidad de los directivos que lo suscriben."

Carlos Vallebuena Garcinava
Director General de la Operadora

Narah Figueroa Hernández
Contralor Normativo