



Profuturo®

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO FONDO PROFUTURO SB4, S.A. DE C.V., SIEFORE, SOCIEDAD DE INVERSIÓN ESPECIALIZADA DE FONDOS PARA EL RETIRO

TIPO DE SIEFORE: Básica 1 () Básica 2 () Básica 3 () Básica 4 (x) Básica de Pensiones () Corto Plazo () Largo Plazo () Previsión Social ()

ESTADOS DE SITUACION FINANCIERA AL 31 DE MARZO DE:

(Cifras en miles de pesos)

	2018	2017		2018	2017
ACTIVO					
DISPONIBLE			PASIVO		
Bancos moneda nacional	1,605,705	1,360,294		62,600	909,234
Bancos monedas extranjeras	150,399	821,884	Divisas por entregar	-	25,841
	1,756,103	2,182,178	Acreedores	51,842	877,203
			Provisiones para gastos	10,758	6,189
RESERVADOS					
Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en MN	-	490,578			
		490,578	TOTAL PASIVO	62,600	909,234
INVERSIONES			CAPITAL CONTABLE		
Inversión en valores de renta variable	12,265,384	11,586,251			
Plus (Menos) valia en valores de renta variable	2,378,544	2,900,086	CAPITAL CONTRIBUIDO	36,059,025	36,303,607
Inversión en instrumentos de deuda nacional de tasa real denominados en pesos y UDIS	22,711,986	19,539,731	Capital social pagado	35,208,648	36,019,546
Plus (Menos) valia en instrumentos de deuda nacional de tasa real denominados en pesos y UDIS	4,001,449	4,327,863	Prima en venta de acciones	850,377	284,061
Inversión en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal denominados en pesos	25,541,585	25,831,852			
Plus (Menos) valia en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal denominados en pesos	-155,558	-415,391	CAPITAL GANADO	33,131,261	29,069,039
Deposito Traspaso Bancario	2,192	-	Resultados de ejercicios anteriores	32,842,358	27,904,153
Inversión en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	191,414	297,420	Resultado del ejercicio	488,904	1,164,886
Plus (Menos) valia en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	69,782	92,739			
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	646,604	1,043,155	OTROS RESULTADOS INTEGRALES	7,129,585	7,670,501
Plus (Menos) valia en instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	61,499	-8,308			
Inversión en FIBRAS	1,789,724	659,860	PLUS (MINUS) VALÍAS	7,129,585	7,670,501
Plus (Menos) valia en inversión en FIBRAS	-88,456	-95,797			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	554,536	483,961			
Inversión en valores extranjeros de deuda	531,479	845,185			
Plus (Menos) valia en inversión en valores extranjeros de deuda	72,392	80,773			
Inversión en Títulos Fiduciarios	2,729,463	2,682,976			
Plus (minus) valia en Títulos Fiduciarios	789,850	788,536			
	74,993,951	70,640,792			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	5,152	200,294			
Dividendos o derechos por cobrar	12,572	2,456			
Intereses devengados sobre valores	514,694	436,082			
	532,417	638,832			
TOTAL ACTIVOS	76,382,471	73,952,380	TOTAL PASIVO Y CAPITAL	76,382,471	73,952,380

CUENTAS DE ORDEN

	2018	2017		2018	2017
Valores entregados en custodia	73,539,415	70,156,931	Capital social autorizado	1,000,000,100	1,000,000,100
Ganancias Recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	2,059	-	Acciones emitidas	208,233,011,885	208,233,011,885
Bancos divisas en moneda extranjera	8,359	43,775	Acciones en circulación posición progia	53,713,672	54,593,875
Dolares americanos	7,761	43,584	Acciones de Siefores, posición de terceros	1	1
Otros Divisas	568	191	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	7,277,888,429	7,445,863,907
Dólar Canadiense	568	191			
Divisas por entregar	-	1,375			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	3,005,923	2,744,414			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición Larga	13,284,339	11,960,386			
Contratos Futuros sobre Renta Fija (Bonos)	1,400,225	1,477,861			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Extranjera	9,504,746	7,751,542			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	-	352,361			
Contratos de Opciones sobre Renta Variable Nacional	368	-			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	2,379,000	2,379,000			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición Corta	12,185,684	13,502,928			
Contratos Futuros sobre Renta Fija (Bonos)	1,692,168	2,250,350			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	3,398,284	2,725,174			
Contratos Futuros sobre Euros	3,722,413	4,635,425			
Contratos Futuros sobre Yenes	-	495,998			
Contratos Futuros sobre Otras Divisas	993,818	1,027,083			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	2,379,000	2,379,000			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:		
Una plus (minus) valia de:	\$ 7,129,585	\$ 7,670,501
Un valor de los activos netos de:	\$ 76,319,871	\$ 73,043,146
El precio de la acción de:	\$ 10.409713	\$ 9.738492

MARTHA BARRERA FERNÁNDEZ

Contador General de 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 17 de Abril de 2018

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

FONDO PROFUTURO SB4, S.A. DE C.V., SOCIEDAD DE INVERSIÓN ESPECIALIZADA DE FONDOS PARA EL RETIRO

TIPO DE SIEFORE: Básica 1 () Básica 2 () Básica 3 () Básica 4 (x) 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:

	2018	2017
Ingresos por la venta de Valores	9,553,087	4,973,885
Intereses, Dividendos, Premios y Derechos	739,295	624,107
Resultado cambiario y Otros productos	-59,510	-137,977
Resultados por Intermediación con Instrumentos Financieros Derivados	-181,323	813,333
Ingresos Netos	10,051,549	6,273,348
Costo de Ventas de Valores	9,373,648	4,922,755
Gastos Generales	3,622	4,283
Comisiones Sobre Saldos	185,375	181,425
Egresos Netos	9,562,645	5,108,463
UTILIDAD DE OPERACIÓN	488,904	1,164,886
Otros Resultados Integrales		
Plus (Minus) valias	-1,200,420	1,101,496
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	-711,516	2,266,382

MARTHA BARRERA FERNÁNDEZ

Contador General de 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 17 de Abril de 2018