



# 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 ( )

## ESTADO DE SITUACIÓN FINANCIERA AL 30 DE SEPTIEMBRE DE:

(Cifras en miles de pesos)

	2017	2016		2017	2016
<b>ACTIVO</b>			<b>PASIVO</b>		
<b>DISPONIBLE</b>			<b>OBLIGACIONES</b>		
Bancos moneda nacional	1,354,899	1,481,563	Divisas por entregar	-	259,872
Bancos monedas extranjeras	533,564	463,491	Acreedores	15,953	343,284
Divisas por recibir	-	120,141	Provisiones para gastos	6,902	6,922
	<b>1,888,463</b>	<b>2,065,196</b>			
<b>RESERVADOS</b>			<b>TOTAL PASIVO</b>	<b>22,855</b>	<b>610,078</b>
Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en MN	-	172,573			
	-	<b>172,573</b>			
<b>INVERSIONES</b>			<b>CAPITAL CONTABLE</b>		
Inversión en valores de renta variable	14,485,795	13,570,889	<b>CAPITAL</b>		
Plus (Minus) valías en Valores de Renta Variable	3,915,759	3,201,751	Capital contribuido	41,157,173	43,476,037
Inversión en instrumentos de deuda nacional de tasa real denominados en pesos y USD	25,331,251	19,781,776	Capital social pagado	38,350,404	40,371,569
Plus (Minus) valía en instrumentos de deuda nacional de tasa real denominados en pesos y USD	5,154,748	5,117,287	Prima en venta de acciones	2,806,769	3,104,467
Inversión en instrumentos de Deuda Nacional de Tasa Nominal Denominados en Pesos	23,632,310	26,662,552	<b>Capital ganado</b>	<b>30,800,976</b>	<b>26,403,269</b>
Plus (Minus) valía en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal denominados en pesos y USD	-170,888	-54,428	Resultados de ejercicios anteriores	27,904,153	24,470,409
Inversión en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	191,414	352,481	Resultado del ejercicio	2,896,823	1,932,860
Plus (Minus) valía en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	65,910	140,932	<b>Otros Resultados Integrales</b>		
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	646,604	1,933,869	Plus (Minus) valías	9,820,729	9,205,474
Plus (Minus) valía en instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	50,874	57,879	<b>TOTAL CAPITAL CONTABLE</b>	<b>81,778,878</b>	<b>79,084,780</b>
Inversión en Fibras	895,736	943,310			
Plus (Minus) valía en Inversión en Fibras	-86,015	-106,237	<b>TOTAL PASIVO Y CAPITAL</b>	<b>81,801,733</b>	<b>79,694,858</b>
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	405,592	702,412			
Inversión en Valores Extranjeros de Deuda	755,237	990,433			
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	92,722	125,538			
Inversión en Títulos Fiduciarios	3,232,473	2,827,391			
Plus (minus) valía en Títulos Fiduciarios	777,819	722,652			
	<b>79,397,541</b>	<b>76,970,587</b>			
<b>DEUDORES DIVERSOS</b>					
Liquidadora	0	29,771			
Dividendos o derechos por cobrar	28,243	1,409			
Intereses devengados sobre valores	487,467	455,323			
	<b>515,729</b>	<b>486,503</b>			
<b>TOTAL ACTIVO</b>	<b>81,801,733</b>	<b>79,694,858</b>			

## CUENTAS DE ORDEN

Valores entregados en custodia	76,991,549	76,268,175	Capital social autorizado	1,000,000,100	1,000,000,100
Ganancias Recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	15,529	-	Acciones emitidas	208,233,011,885	208,233,011,885
Bancos divisas en moneda extranjera	29,463	24,056	Acciones en circulación posición progia	58,410,487	61,094,169
Dólares americanos	29,063	23,483	Acciones de Siefores, Posición de Terceros	1	1
Dólares canadienses	400	573	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	7,927,408,881	8,345,598,438
Divisas por recibir	-	6,200			
Dólares americanos	-	6,200			
Divisas por entregar	-	13,411			
Dólares americanos	-	13,411			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	3,641,143	2,745,081			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición Larga	11,561,135	11,703,473			
Contratos Futuros sobre Renta Fija (Bonos)	1,540,189	-			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Extranjera	7,641,576	7,853,290			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	-	1,471,152			
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	13,058,059	17,147,536			
Contratos Futuros sobre Renta Fija (Bonos)	2,207,648	3,407,015			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	3,790,008	3,450,279			
Contratos Futuros sobre Euro	3,983,541	5,208,754			
Contratos Futuros sobre Yen	171,181	1,461,761			
Contratos Futuros sobre Otras Divisas	1,127,251	1,240,526			
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) valía de:	\$ 9,820,729	\$ 9,205,474
Un valor de los activos netos de:	\$ 81,778,878	\$ 79,084,780
El precio de la acción de:	\$ 10.240512	\$ 9.407360

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 octubre de 2017

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 30 de Septiembre de:

	2017	2016
Ingresos por la venta de Valores	27,044,113	16,597,719
Intereses, dividendos, premios y derechos	1,920,052	1,982,196
Resultado cambiario / Otros productos	-154,547	146,100
Resultados por Intermediación con Instrumentos Financieros Derivados	1,234,216	-345,116
<b>Ingresos Netos</b>	<b>30,043,834</b>	<b>18,380,899</b>
Costo de ventas de valores	26,560,201	15,845,366
Gastos generales	11,674	22,291
Comisiones sobre saldos	575,135	580,381
<b>Egresos netos</b>	<b>27,147,010</b>	<b>16,448,039</b>
<b>Utilidad de operación</b>	<b>2,896,823</b>	<b>1,932,860</b>
<b>Otros Resultados Integrales</b>		
Plus (Minus) Valías	3,251,724	3,495,594
<b>UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO</b>	<b>6,148,546</b>	<b>5,428,454</b>

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 octubre de 2017