



# 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)

	2019	2018		2019	2018
<b>ACTIVO</b>			<b>PASIVO</b>		
<b>DISPONIBLE</b>			OBLIGACIONES	523,282	1,069,313
Bancos moneda nacional	607,961	1,210,801	Divisas por entregar	37,455	-
Bancos monedas extranjeras	505,696	1,440,820	Acreedores	483,210	1,061,875
Divisas por recibir	21,905	-	Provisiones para gastos	2,617	7,438
	<b>1,135,562</b>	<b>2,651,621</b>			
<b>INVERSIONES</b>			<b>TOTAL PASIVO</b>	<b>523,282</b>	<b>1,069,313</b>
Inversión en valores de renta variable	15,423,730	12,658,182			
Plus (Minus) valia en valores de renta variable	1,589,807	2,063,800	<b>CAPITAL CONTABLE</b>		
Inversión en instrumentos de deuda nacional de tasa real denominados en pesos y UDIS	34,294,104	25,239,088	CAPITAL CONTRIBUIDO	47,255,729	44,621,284
Plus (Minus) valia en instrumentos de deuda nacional de tasa real denominados en pesos y UDIS	6,045,032	4,351,452	Capital social pagado	39,646,683	39,057,019
Inversión en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal denominados en pesos	28,206,314	33,837,568	Prima en venta de acciones	7,609,046	5,564,265
Plus (Minus) valia en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal denominados en pesos	448,209	-483,176	<b>CAPITAL GANADO</b>	<b>40,675,287</b>	<b>37,155,540</b>
Inversión en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	27,501	191,414	Resultados de ejercicios anteriores	36,623,266	32,642,358
Plus (Minus) valia en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	15,721	59,480	Resultado del ejercicio	4,052,021	4,513,182
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	422,408	647,867			
Plus (Minus) valia en instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	71,507	76,026	<b>OTROS RESULTADOS INTEGRALES</b>	<b>8,732,463</b>	<b>6,813,383</b>
Inversión en FIBRAS	1,034,135	1,699,989	PLUS (MINUS) VALIAS	8,732,463	6,813,383
Plus (Minus) valia en Inversión en FIBRAS	-10,194	-108,332			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	326,037	461,805	<b>TOTAL CAPITAL CONTABLE</b>	<b>96,663,479</b>	<b>88,590,207</b>
Inversión en valores extranjeros de deuda	488,285	380,912	<b>TOTAL PASIVO Y CAPITAL</b>	<b>97,186,761</b>	<b>89,659,520</b>
Plus (Minus) valia en Inversión en valores extranjeros de deuda	87,238	69,440			
Plus (Minus) valia en Instrumentos Financieros Derivados	4,665,414	3,402,386			
Plus (minus) valia en Títulos Fiduciarios	576,891	784,713			
Inversión en instrumentos de deuda por reporto	1,650,449	-			
Plus (Minus) valia de valores por reporto	2,652	-			
	<b>95,274,852</b>	<b>85,532,474</b>			
<b>DEUDORES DIVERSOS</b>					
Liquidadora	81,921	841,083			
Dividendos o derechos por cobrar	1,523	31,129			
Intereses devengados sobre valores	685,833	603,213			
Reportos	-2,595	-			
Intereses devengados por instrumentos recibidos en reporto	9,655	-			
	<b>776,347</b>	<b>1,475,425</b>			
<b>TOTAL ACTIVO</b>	<b>97,186,761</b>	<b>89,659,520</b>			

### CUENTAS DE ORDEN

Valores entregados en custodia	93,295,515	85,070,669	Capital social autorizado	1,000,000,100	1,000,000,100
Valores entregados en custodia por reporto	1,660,371	-	Acciones emitidas	208,233,011,885	208,233,011,885
Garantías Recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	329	1,373	Acciones en circulación posición propia	58,756,008	58,777,419
Bancos divisas en moneda extranjera	25,674	77,376	Acciones de Siefores posición de terceros	1	1
Dólares americanos	25,239	75,165	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	8,196,991,302	8,074,382,398
Euro	172	305			
Otras Divisas	262	2,006			
Dólar Canadiense	262	2,006			
Divisas por recibir	1,110	-			
Dólares americanos	1,110	-			
Divisas por entregar	1,898	-			
Dólares americanos	1,898	-			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	3,602,554	4,312,848			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición Larga	8,607,548	13,247,640			
Contratos Futuros sobre Renta Fija (Bonos)	1,569,203	1,190,097			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Extranjera	4,659,086	9,503,423			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	-	165,752			
Contratos de Opciones sobre Renta Variable Nacional	258	988			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	2,379,000	2,379,000			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición Corta	11,698,654	7,030,145			
Contratos Futuros sobre Renta Fija (Bonos)	1,173,084	1,004,686			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	6,342,453	401,139			
Contratos Futuros sobre Euros	1,818,593	2,109,057			
Contratos Futuros sobre Yenes	20,696	-			
Contratos Futuros sobre Otras Divisas	972,869	1,136,284			
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:	\$ 8,732,463	\$ 6,813,383
Un valor de los activos netos de:	\$ 96,663,479	\$ 88,590,207
El precio de la acción de:	\$ 11,709,629	\$ 10,892,739

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 30 de Octubre de 2019

## 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 RESULTADOS INTEGRAL

(Cifras en miles de pesos)

Por los periodos al 30 de Septiembre de:

	2019	2018
Ingresos por la venta de Valores	23,871,111	39,536,682
Intereses, Dividendos, Premios y Derechos	2,804,250	2,441,571
Resultado cambiario / Otros productos	-10,554	86,594
Resultados por Intermediación con Instrumentos Financieros Derivados	1,524,220	1,120,453
<b>Ingresos Netos</b>	<b>28,289,027</b>	<b>43,012,112</b>
Costo de Ventas de Valores	23,587,758	37,879,641
Gastos Generales	8,436	10,899
Comisiones Sobre Saldos	628,402	608,360
Intereses sobre inversiones en valores a entregar	11,410	0
<b>Egresos netos</b>	<b>24,237,006</b>	<b>38,498,930</b>
<b>UTILIDAD DE OPERACIÓN</b>	<b>4,052,021</b>	<b>4,513,182</b>
<b>Otros Resultados Integrales</b>	<b>5,707,157</b>	<b>-1,516,623</b>
Plus (Minus) Valias		
<b>UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO</b>	<b>9,759,178</b>	<b>2,996,559</b>

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

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 30 de Octubre de 2019