



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 31 DE DICIEMBRE DE:

(Cifras en miles de pesos)

	2017	2016		2017	2016
ACTIVO					
DISPONIBLE			PASIVO		
Bancos moneda nacional	1,338,109	759,453	Obligaciones		
Bancos monedas extranjeras	490,662	739,490	Divisas por entregar	61,893	40,841
	1,828,801	1,497,943	Acreedores	28,125	29,964
			Provisiones para gastos	8,138	5,946
INVERSIONES			TOTAL PASIVO	98,156	76,751
Inversión en valores de renta variable	11,500,929	11,342,977			
Plus (Minus) valías en Valores de Renta Variable	3,900,420	3,045,737	CAPITAL CONTABLE		
Inversión en instrumentos de deuda nacional de tasa real denominados en pesos y USD	20,885,227	16,592,266			
Plus (Minus) valía en instrumentos de deuda nacional de tasa real denominados en pesos y USD	4,048,928	3,519,900	CAPITAL		
Inversión en instrumentos de Deuda Nacional de Tasa Nominal Denominados en Pesos	24,071,736	25,379,399	Capital contribuido	31,404,336	34,077,324
Plus (Minus) valía en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal denominados en pesos	-428,271	-783,884	Capital social pagado	33,075,093	34,910,254
Depósito traspaso Bancario	2,182	-	Prima en venta de acciones	-1,670,757	-832,930
Plus (Minus) valía en inversión en el Depósito Traspaso Bancario	1	-	Capital ganado	32,642,358	27,904,153
Inversión en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	191,414	297,420	Resultados de ejercicios anteriores	27,904,153	24,470,408
Plus (Minus) valía en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	91,564	119,457	Resultado del ejercicio	4,738,205	3,433,745
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	646,604	1,636,668	Otros Resultados Integrales		
Plus (Minus) valía en instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	53,919	20,519	Plus (Minus) valías	8,330,006	6,569,006
Inversión en Fibras	984,004	981,472			
Plus (Minus) valía en Inversión en Fibras	-73,606	-132,354	TOTAL CAPITAL CONTABLE	72,376,700	68,550,483
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	413,889	550,203			
Inversión en Valores Extranjeros de Deuda	562,217	845,185	TOTAL PASIVO Y CAPITAL	72,474,856	68,627,234
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	66,449	72,246			
Inversión en Títulos Fiduciarios	2,771,165	2,680,724			
Plus (minus) valía en Títulos Fiduciarios	670,802	737,385			
	70,389,172	66,875,320			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	0	19,324			
Dividendos o derechos por cobrar	24,603	2,423			
Intereses devengados sobre valores	232,279	232,224			
	256,882	253,971			
TOTAL ACTIVO	72,474,856	68,627,234			

CUENTAS DE ORDEN

Valores entregados en custodia	69,975,484	66,325,114	Capital social autorizado	1,000,000,100	1,000,000,100
Garantías Recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	1,911	-	Acciones emitidas	208,233,011,885	208,233,011,885
Bancos divisas en moneda extranjera	25,053	35,840	Acciones en circulación posición propia	50,799,903	53,388,491
Dólares americanos	24,570	35,744	Acciones de Siefiores, Posición de Terceros	5	1
Otros Dólares	483	95	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	6,836,525,637	7,216,078,025
Dólar canadiense	483	95			
Divisas por entregar	3,148	1,981			
Dólares americanos	3,148	1,981			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	3,579,765	2,796,851			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición Larga	13,151,685	11,241,397			
Contratos Futuros sobre Renta Fija (Bonos)	1,618,306	1,184,029			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Extranjera	9,040,356	7,678,368			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	113,655	-			
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	10,865,070	13,142,157			
Contratos Futuros sobre Renta Fija (Bonos)	2,035,291	2,287,961			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	1,703,712	2,370,396			
Contratos Futuros sobre Euros	3,700,196	4,539,426			
Contratos Futuros sobre Yenes	-	524,240			
Contratos Futuros sobre Otras Divisas	1,041,851	1,041,224			
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:	\$ 8,330,006	\$ 6,569,006			
Un valor de los activos netos de:	\$ 72,376,700	\$ 68,550,483			
El precio de la acción de:	\$ 10.90680	\$ 9.429919			

MARTHA BARRERA FERNÁNDEZ
Cortador General SIEFORE

ARTURO GARCÍA RODRÍGUEZ
Director General

GUILLEMO BABATZ GARCÍA
Comisario

Declaro bajo protesta de decir verdad que los datos contenidos son auténticos y veraces

Declaro bajo protesta de decir verdad que los datos contenidos son auténticos y veraces

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 20 de febrero 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 Diciembre de:

	2017	2016
Ingresos por la venta de Valores	51,114,187	36,168,902
Intereses, dividendos, premios y derechos	2,721,823	2,621,273
Resultado cambiario / Otros productos	-47,897	202,918
Resultados por Intermediación con Instrumentos Financieros Derivados	1,611,331	296,152
Ingresos Netos	55,389,444	39,289,245
Costo de ventas de valores	49,878,225	35,058,541
Gastos generales	15,985	28,035
Comisiones sobre saldos	767,029	768,924
Egresos netos	50,661,239	35,855,500
Utilidad de operación	4,738,205	3,433,745
Otros Resultados Integrales		
Plus (Minus) Valías	1,761,000	859,126
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	6,499,205	4,292,871

MARTHA BARRERA FERNÁNDEZ
Cortador General SIEFORE

ARTURO GARCÍA RODRÍGUEZ
Director General

GUILLEMO BABATZ GARCÍA
Comisario

Declaro bajo protesta de decir verdad que los datos contenidos son auténticos y veraces

Declaro bajo protesta de decir verdad que los datos contenidos son auténticos y veraces

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 20 de febrero de 2018