

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

FONDO PROFUTURO SB 60-64, S.A. DE C.V.,

SOCIEDAD DE INVERSIÓN ESPECIALIZADA DE FONDOS PARA EL RETIRO

(antes Fondo Profuturo SB2, S.A. de C.V., Sociedad de Inversión Especializada De Fondos para el Retiro)

ESTADOS DE SITUACIÓN FINANCIERA AL 31 DE MARZO DE:

(Cifras en miles de pesos)

	2020	2019		2020	2019
ACTIVO			PASIVO		
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	769,413	1,905,988		333,220	1,173,362
Plus (Mínus) valles en valores de renta variable	831,851	1,418,043	Divisas por entregar		244,892
Bancos monedas extranjeras	40,058	520,271	Acreedores		496,221
Divisas por recibir	<u>1,641,422</u>	<u>4,254,302</u>	Provisiones para gastos	1,959	17,770
RESERVADOS					
Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en divisas	3,011	-			
	<u>3,011</u>	-			
INVERSIONES			TOTAL PASIVO	<u>333,220</u>	<u>1,173,362</u>
Inversión en valores de renta variable	10,294,770	28,812,834			
Plus (Mínus) valles en valores de renta variable	740,792	4,185,291			
Inversión en instrumentos de deuda nacional de tasa real denominados en pesos y UDS	32,393,123	82,715,039			
Plus (Mínus) valles en instrumentos de deuda nacional de tasa real denominados en pesos y UDS	3,932,182	7,914,358			
Inversión en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal denominados en pesos	21,534,808	74,604,586			
Plus (Mínus) valles en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal denominados en pesos	68,407	-1,557,573			
Deposito Traspaso Bancario	646,185	891,105			
Plus (Mínus) valles en inversión en el Depósito Traspaso Bancario	9,992	4,583			
Inversión en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	29,356	316,348			
Plus (Mínus) valles en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	23,802	102,521			
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	720,457	1,145,515			
Plus (Mínus) valles en instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	135,910	169,500			
Inversión en FIBRAS	1,032,620	3,079,696			
Plus (Mínus) valles en inversión en FIBRAS	-270,025	-370,473			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	616,217	507,855			
Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	721	1,029,356			
Inversión en valores extranjeros de deuda	618,142	203,416			
Plus (Mínus) valles en inversión en valores extranjeros de deuda	104,208	203,416			
Inversión en Títulos Fiduciarios	2,010,203	8,223,277			
Plus (mínus) valles en Títulos Fiduciarios	498,382	1,379,768			
	<u>75,140,370</u>	<u>213,359,190</u>			
DEUDORES DIVERSOS			PLUS (MÍNUS) VALÍAS	<u>5,243,650</u>	<u>12,031,491</u>
Liquidaciones	102,353	425,756			
Dividendos o derechos por cobrar	566	7,090			
Intereses devengados sobre valores	653,470	1,768,069			
Reportes	300,055	-			
Reembolsos y otros intereses	159	-			
	<u>1,056,592</u>	<u>2,220,942</u>			
TOTAL ACTIVO	<u>77,841,395</u>	<u>219,834,434</u>	TOTAL CAPITAL CONTABLE	<u>77,508,175</u>	<u>218,661,072</u>
			TOTAL PASIVO Y CAPITAL	<u>77,841,395</u>	<u>219,834,434</u>

CUENTAS DE ORDEN

Valores entregados en custodia	74,524,152	212,851,335	Capital social autorizado	1,000,000,100	1,000,000,100
Garantías recibidas en custodia por Reportes	300,464	-	Acciones emitidas	1,000,000,100,000	1,000,000,100,000
Garantías Recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	-	3,634	Acciones en circulación posición propia	54,803,745	164,220,865
Bancos divisas en moneda extranjera	35,679	73,257	Acciones de Señores posición de tenedores	1	1
Dólares americanos	34,442	72,943	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	7,478,560,774	22,562,713,365
Euro	291	-			
Otras Divisas	946	314			
Dólar Canadiense	946	314			
Divisas por recibir	1,706	48,007			
Dólares americanos	1,706	48,007			
Depositos reservados al pago de compromisos futuros en moneda extranjera	128	-			
Dólares americanos	128	-			
Divisas por entregar	10,419	34,027			
Dólares americanos	10,419	34,027			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	17,367	7,319,364			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición Larga	5,668,586	9,214,438			
Contratos Futuros sobre Renta Fija (Bonos)	3,375,351	2,769,280			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	15,662	57,408			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Extranjera	2,229,114	6,199,832			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	-	187,051			
Contratos de Opciones sobre Renta Variable Nacional	-	967			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	63,439	19,259,882			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición Corta	8,226,870	2,662,741			
Contratos Futuros sobre Renta Fija (Bonos)	2,892,409	10,156,668			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	3,535,254	3,271,037			
Contratos Futuros sobre Euro	758,237	1,572,263			
Contratos Futuros sobre Yen	581,761	1,567,173			
Contratos Futuros sobre Otras Divisas	461,207	-			
La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:					
Una plus (mínus) valles de:	\$ 5,243,650	\$ 12,031,491			
Un valor de los activos netos de:	\$ 77,508,175	\$ 218,661,072			
El precio de la acción de:	\$ 10.286653	\$ 9.621230			

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 28 de Abril de 2020.

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

FONDO PROFUTURO SB 60-64, S.A. DE C.V.,

SOCIEDAD DE INVERSIÓN ESPECIALIZADA DE FONDOS PARA EL RETIRO

(antes Fondo Profuturo SB2, S.A. de C.V., Sociedad de Inversión Especializada De Fondos para el Retiro)

ESTADO DE RESULTADO INTEGRAL

(Cifras en miles de pesos)

Por los periodos al 31 de Marzo de:

	2020	2019
Ingresos por la Venta de Valores	6,804,587	25,468,245
Intereses, Dividendos, Premios y Derechos	795,042	2,196,122
Resultados cambiarios / Otros productos	172,710	-14,851
Resultados por Intermediación con Instrumentos Financieros Derivados	-664,261	1,177,493
Ingresos Netos	<u>7,108,078</u>	<u>28,827,009</u>
Costo de Ventas de Valores	6,722,257	24,102,161
Gastos Generales	1,364	5,184
Comisiones Sobre Saldos	178,981	512,709
Egresos Netos	<u>6,902,602</u>	<u>24,620,054</u>
UTILIDAD OPERACIÓN	<u>205,476</u>	<u>4,206,955</u>
Otros Resultados Integrales		
Plus (Mínus) valles	-1,657,064	4,968,037
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	<u>-1,451,588</u>	<u>9,174,992</u>

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 28 de Abril de 2020.