



Profuturo®

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

FONDO PROFUTURO SB 85-89, S.A. DE C.V.,

SOCIEDAD DE INVERSIÓN ESPECIALIZADA DE FONDOS PARA EL RETIRO

(antes Fondo Profuturo SB4, S.A. de C.V., Sociedad de Inversión Especializada de Fondos para el Retiro)

ESTADOS DE SITUACIÓN FINANCIERA AL 30 DE SEPTIEMBRE DE:

(Cifras en miles de pesos)

| | 2022 | 2021 | | 2022 | 2021 |
|---|-------------------|-------------------|-------------------------------------|-------------------|-------------------|
| ACTIVO | | | PASIVO | | |
| DISPONIBLE | | | OBLIGACIONES | 442,913 | 424,295 |
| Bancos moneda nacional | 1,156,340 | 962,995 | Divisas por entregar | 255,767 | 413,402 |
| Bancos monedas extranjeras | 698,409 | 1,504,533 | Acreedores | 183,850 | 9,506 |
| Divisas por recibir | 1,844,749 | 2,467,528 | Provisiones para gastos | 3,296 | 1,387 |
| RESERVADOS | - | - | TOTAL PASIVO | 442,913 | 424,295 |
| Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en divisas | - | - | | | |
| INVERSIONES | | | CAPITAL CONTABLE | | |
| Inversión en valores de renta variable | 10,708,733 | 10,785,194 | CAPITAL CONTRIBUIDO | 21,782,892 | 7,171,613 |
| Plus (Mínus) valía en valores de renta variable | -1,230,656 | 1,388,841 | Capital Social pagado | 24,988,109 | 20,114,679 |
| Inversión en instrumentos de deuda nacional de tasa real denominados en pesos y UDS | 18,252,332 | 18,649,614 | Prima en venta de acciones | -3,205,217 | -12,943,066 |
| Plus (Mínus) valía en instrumentos de deuda nacional de tasa real denominados en pesos y UDS | 1,865,753 | 3,312,564 | CAPITAL GANADO | 47,532,060 | 49,057,912 |
| Inversión en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal denominados en pesos | 30,404,830 | 17,777,287 | Resultados de ejercicios anteriores | 50,987,623 | 45,430,626 |
| Plus (Mínus) valía en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal denominados en pesos | -702,408 | -370,062 | Resultado del ejercicio | -3,455,563 | 3,627,286 |
| Inversión en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso | 663,294 | 53,797 | OTROS RESULTADOS INTEGRALES | 523,200 | 4,785,556 |
| Plus (Mínus) valía en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso | -48,502 | 3,670 | PLUS (MÍNUS) VALÍAS | 523,200 | 4,785,556 |
| Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas | 731,594 | 290,273 | TOTAL CAPITAL CONTABLE | 69,838,152 | 61,015,081 |
| Plus (Mínus) valía en instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas | 75,953 | 38,530 | | | |
| Inversión en FIBRAS | 183,460 | 340,723 | TOTAL PASIVO Y CAPITAL | 70,281,065 | 61,439,376 |
| Plus (Mínus) valía en Inversión en FIBRAS | 14,033 | -32,952 | | | |
| Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados | 1,074,236 | 936,082 | | | |
| Pérdidas por egreso de Instrumentos Financieros Derivados (OTC) | 2,084 | 6 | | | |
| Inversión en valores extranjeros de deuda | 179,251 | 146,051 | | | |
| Plus (Mínus) valía en inversión en valores extranjeros de deuda | 14,872 | 25,486 | | | |
| Inversión en Títulos Fiduciarios | 4,057,878 | 3,057,149 | | | |
| Plus (Mínus) valía en Títulos Fiduciarios | 640,863 | 419,368 | | | |
| Inversión en Fondos Mutuos | 656,521 | - | | | |
| Plus (Mínus) valía en Fondos Mutuos | -106,609 | - | | | |
| | 67,445,812 | 56,801,731 | | | |
| DEUDORES DIVERSOS | | | | | |
| Liquidadora | 207,108 | 243,146 | | | |
| Dividendos o derechos por cobrar | - | 891 | | | |
| Intereses devengados sobre valores | 501,604 | 425,789 | | | |
| Reportes | 280,218 | 1,510,197 | | | |
| Reembolsos y otros intereses | 1,514 | 125 | | | |
| | 990,504 | 2,180,147 | | | |
| TOTAL ACTIVO | 70,281,065 | 61,439,376 | | | |

CUENTAS DE ORDEN

| | | | | | |
|---|------------|------------|---|-----------------|-----------------|
| Valores entregados en custodia | 66,371,576 | 55,865,649 | Capital social autorizado | 1,000,000,100 | 1,000,000,100 |
| Garantías recibidas en custodia por Reportes | 280,358 | 1,510,762 | Acciones emitidas | 208,233,011,885 | 208,233,011,885 |
| Bancos divisas en moneda extranjera | 34,443 | 73,258 | Acciones en circulación posición propia | 26,861,034 | 25,965,996 |
| Dólares americanos | 33,621 | 72,541 | Acciones de Señores posición de terceros | 1 | 1 |
| Euro | 169 | 170 | Acciones en circulación propiedad de los trabajadores | 5,176,547,734 | 4,162,573,781 |
| Otras Divisas | 652 | 547 | | | |
| Dólar Caribeñense | 652 | 547 | | | |
| Divisas por entregar | 12,729 | 20,105 | | | |
| Dólares americanos | 12,729 | 20,105 | | | |
| Compromisos futuros por la adquisición de Títulos Fiduciarios | 997,792 | 964,654 | | | |
| Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición Larga | 26,593,639 | 19,386,567 | | | |
| Contratos Futuros sobre Renta Fija (Bonos) | 1,870,149 | - | | | |
| Contratos Futuros sobre Renta Variable Extranjera | 16,984,004 | 15,459,342 | | | |
| Contratos Futuros sobre Dólar Americano | 5,348,351 | 3,560,546 | | | |
| Contratos Futuros sobre Yen | 372,239 | 347,783 | | | |
| Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional | 18,896 | 18,896 | | | |
| Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición Corta | 4,558,791 | 5,537,035 | | | |
| Contratos Futuros sobre Renta Fija (Bonos) | 2,906,892 | 2,953,483 | | | |
| Contratos Futuros sobre Euros | 310,394 | 1,216,425 | | | |
| Contratos Futuros sobre Otras Divisas | 1,291,504 | 1,367,128 | | | |

| | | | | | |
|--|---------------|---------------|--|--|--|
| La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó: | | | | | |
| Una plus (mínus) valía de: | \$ 523,200 | \$ 4,785,556 | | | |
| Un valor de los activos netos de: | \$ 69,838,152 | \$ 61,015,081 | | | |
| El precio de la acción de: | \$ 13,421,770 | \$ 14,567,148 | | | |

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 18 de octubre de 2022.

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

FONDO PROFUTURO SB 85-89, S.A. DE C.V.,

SOCIEDAD DE INVERSIÓN ESPECIALIZADA DE FONDOS PARA EL RETIRO

(antes Fondo Profuturo SB4, 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 30 de Septiembre de:

| | 2022 | 2021 |
|--|-------------------|-------------------|
| Ingresos por la Venta de Valores | 26,370,989 | 11,369,791 |
| Intereses, Dividendos, Premios y Derechos | 1,792,143 | 1,318,976 |
| Resultados cambiarios / Otros productos | -124,790 | 58,224 |
| Resultados por Intermediación con Instrumentos Financieros Derivados | -4,915,588 | 1,665,272 |
| Ingresos Netos | 23,122,964 | 14,412,263 |
| Costo de Ventas de Valores | 26,273,119 | 10,442,663 |
| Gastos Generales | 11,269 | 7,433 |
| Comisiones Sobre Saldos | 294,142 | 334,881 |
| Comisiones por gestión de Fondos Mutuos | 17 | 0 |
| Egresos Netos | 26,578,547 | 10,784,977 |
| OTROS RESULTADOS INTEGRALES | -3,455,563 | 3,627,286 |
| Plus (Mínus) valías | -5,068,284 | -773,406 |
| UTILIDAD OPERACIÓN | -3,455,563 | 3,627,286 |
| UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO | -8,523,847 | 2,853,880 |

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 18 de octubre de 2022.