



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 31 DE MARZO DE:

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2022	2021	PASIVO	2022	2021
DISPONIBLE				416,172	615,118
Bancos moneda nacional	552,468	546,846			
Bancos monedas extranjeras	1,508,402	1,284,239	Divisas por entregar	284,748	-
Divisas por recibir	39,536	-	Acreedores	130,337	609,234
	<u>2,517,706</u>	<u>1,831,085</u>	Provisiones para gastos	1,087	5,884
RESERVADOS					
Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en divisas	-	-			
INVERSIONES					
Inversión en valores de renta variable	12,426,289	7,802,112			
Plus (Menus) valia en valores de renta variable	1,172,260	1,383,760			
Inversión en instrumentos de deuda nacional de tasa real denominados en pesos y USDS	17,630,138	17,808,377			
Plus (Menus) valia en instrumentos de deuda nacional de tasa real denominados en pesos y USDS	2,865,765	3,092,174			
Inversión en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal denominados en pesos	24,706,468	13,940,322			
Plus (Menus) valia en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal denominados en pesos	-561,292	-143,606			
Deposito Traspaso Bancario	41,081	20,172			
Plus (Menus) valia en inversión en el Deposito Traspaso Bancario	798	496			
Inversión en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	51,694	60,539			
Plus (Menus) valia en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	-2,478	3,594			
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	731,964	295,720			
Plus (Menus) valia en instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	52,005	37,581			
Inversión en FIBRAS	223,997	343,229			
Plus (Menus) valia en inversión en FIBRAS	-4,666	-58,142			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	1,195,839	782,409			
Primas por ejercicio de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	1,923	170,551			
Inversión en valores extranjeros de deuda	146,051	40,700			
Plus (Menus) valia en inversión en valores extranjeros de deuda	20,812	2,782,008			
Inversión en Títulos Fiduciarios	3,421,200	304			
Plus (minus) valia en Títulos Fiduciarios	708,225	190,413			
Inversión en Fondos Mutuos	450,929	-			
Plus (minus) valia en Fondos Mutuos	-35,588	-			
	<u>65,273,232</u>	<u>48,642,384</u>			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	53,592	115			
Dividendos e intereses por cobrar	-	4,144			
Intereses devengados sobre valores	444,219	387,708			
Reportes	1,480,268	1,400,797			
Reembolsos y otros intereses	804	-			
	<u>1,978,883</u>	<u>1,793,068</u>			
TOTAL ACTIVO	<u>69,769,821</u>	<u>52,266,537</u>			
			TOTAL PASIVO Y CAPITAL	<u>69,769,821</u>	<u>52,266,537</u>

CUENTAS DE ORDEN

Valores entregados en custodia	64,077,393	47,859,974	Capital social autorizado	1,000,000,100	1,000,000,100
Garantías recibidas en custodia por Reportes	1,481,125	1,396,584	Acciones emitidas	208,233,011,885	208,233,011,885
Bancos divisas en moneda extranjera	96,950	62,894	Acciones en circulación posición propia	25,991,977	22,978,299
Divisas americanas	99,186	62,392	Acciones de Señores posición de terceros	1	1
Euro	169	170	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	4,631,298,908	3,686,344,945
Otras Divisas	594	461			
Dólar Canadiense	584	461			
Divisas por recibir	1,850	-			
Dólares americanos	1,850	-			
Divisas por entregar	14,301	-			
Dólares americanos	14,301	-			
Compromisos futuros por la adquisición de Títulos Fiduciarios	972,987	1,023,592			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición Larga	27,066,863	17,000,669			
Contratos Futuros sobre Renta Fija (Bonos)	1,116,290	139,753			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Extranjera	19,750,616	11,524,427			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	5,769,870	2,838,473			
Contratos Futuros sobre Tese	410,191	301,121			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	-	2,378,000			
Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional	18,896	18,896			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición Corta	10,510,544	6,240,559			
Contratos Futuros sobre Renta Fija (Bonos)	8,065,994	1,607,237			
Contratos Futuros sobre Euros	730,044	754,541			
Contratos Futuros sobre Otras Divisas	1,714,505	1,500,780			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	-	2,378,000			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:					
Una plus (minus) valia de:	\$ 4,245,629	\$ 4,546,940			
Un valor de los activos netos de:	\$ 69,353,649	\$ 51,651,419			
El precio de la acción de:	\$ 14.891542	\$ 13.524755			

MARTHA BARRERA FERNÁNDEZ
Contador General de SIFORE

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 20 de abril 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 31 de Marzo de:

	2022	2021
Ingresos por la Venta de Valores	4,068,447	4,268,338
Intereses, Dividendos, Premios y Derechos	475,869	376,707
Resultados cambiarios / Otros productos	-117,957	36,664
Resultados por Intermediación con Instrumentos Financieros Derivados	-497,575	698,133
Ingresos Netos	<u>3,928,784</u>	<u>5,379,842</u>
Ingresos Netos		
Costo de Ventas de Valores	3,851,556	3,872,852
Gastos Generales	3,736	2,506
Comisiones Sobre Saldos	91,304	103,987
Egresos Netos	<u>3,946,596</u>	<u>3,979,345</u>
Otros Resultados Integrales		
Plus (Minus) valias	-17,812	1,400,497
UTILIDAD OPERACIÓN	<u>-1,345,854</u>	<u>-1,012,021</u>
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	<u>-1,363,666</u>	<u>388,476</u>

MARTHA BARRERA FERNÁNDEZ
Contador General de SIFORE

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 20 de abril de 2022.