

## 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)

	2020	2019		2020	2019
<b>ACTIVO</b>			<b>PASIVO</b>		
<b>DISPONIBLE</b>					
Bancos moneda nacional	892,725	750,389		403,905	192,098
Bancos monedas extranjeras	587,539	2,504,381	Divisas por entregar	99,319	425
Divisas por recibir	-	-	Acreedores	303,714	184,941
	<b>1,480,264</b>	<b>3,254,770</b>	Provisiones para gastos	872	6,732
<b>RESERVADOS</b>				<b>403,905</b>	<b>192,098</b>
Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en divisas	-	-			
			<b>TOTAL PASIVO</b>	<b>403,905</b>	<b>192,098</b>
<b>INVERSIONES</b>					
Inversión en valores de renta variable	5,719,618	12,947,503			
Plus (Mínus) valía en valores de renta variable	70,242	1,257,927			
Inversión en instrumentos de deuda nacional de tasa real denominados en pesos y UDIS	13,025,355	27,327,598			
Plus (Mínus) valía en instrumentos de deuda nacional de tasa real denominados en pesos y UDIS	1,790,296	3,713,985			
Inversión en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal denominados en pesos	8,189,892	27,212,722			
Plus (Mínus) valía en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal denominados en pesos	40,890	-384,428			
Depósito Traspaso Bancario	9,233	3,034	<b>CAPITAL CONTRIBUIDO</b>	<b>-8,633,117</b>	<b>39,344,643</b>
Plus (Mínus) valía en inversión en el Depósito Traspaso Bancario	143	16	Capital Social pagado	14,271,602	36,300,769
Inversión en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	9,845	110,578	Prima en venta de acciones	-23,904,719	3,043,874
Plus (Mínus) valía en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	7,171	29,475			
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	444,911	647,897	<b>CAPITAL GANADO</b>	<b>41,974,274</b>	<b>38,306,199</b>
Plus (Mínus) valía en instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	51,922	91,734	Resultados de ejercicios anteriores	42,160,614	36,823,266
Inversión en FIBRAS	362,853	1,034,195	Resultados del ejercicio	-186,340	1,682,933
Plus (Mínus) valía en Inversión en FIBRAS	-89,088	-133,917			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	531,844	481,506	<b>OTROS RESULTADOS INTEGRALES</b>	<b>2,108,917</b>	<b>5,238,713</b>
Primas por ejercicio de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	215	321,424			
Inversión en valores extranjeros de deuda	163,500	30,119	<b>PLUS (MÍNUS) VALÍAS</b>	<b>2,108,917</b>	<b>5,238,713</b>
Plus (Mínus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	30,119	60,147			
Inversión en Títulos Fiduciarios	1,863,120	3,950,164			
Plus (Mínus) valía en Títulos Fiduciarios	184,312	603,194			
	<b>32,425,143</b>	<b>79,265,704</b>			
<b>DEUDORES DIVERSOS</b>					
Liquidadora	61,888	8,064			
Dividendos o derechos por cobrar	1,000	2,917			
Intereses devengados sobre valores	255,607	810,198			
Reportes	630,116	-			
Reembolsos y otros intereses	161	-			
	<b>948,572</b>	<b>621,179</b>	<b>TOTAL CAPITAL CONTABLE</b>	<b>34,450,074</b>	<b>82,889,555</b>
<b>TOTAL ACTIVO</b>	<b>34,853,979</b>	<b>83,081,653</b>	<b>TOTAL PASIVO Y CAPITAL</b>	<b>34,853,979</b>	<b>83,081,653</b>

#### CUENTAS DE ORDEN

Valores entregados en custodia	31,893,299	78,744,198	Capital social autorizado	1,000,000,100	1,000,000,100
Garantías recibidas en custodia por Reportes	630,975	1,023,075	Acciones emitidas	208,233,011,885	208,233,011,885
Garantías Recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	-	1,082	Acciones en circulación posición propia	22,001,340	53,928,673
Bancos divisas en moneda extranjera	25,110	129,269	Acciones de Siferos posición de tenencia	1	1
Divisas americanas	24,373	193,149	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	2,949,817,030	7,505,089,100
Euro	172	-			
Otras Divisas	385	120			
Dólar Canadiense	365	120			
Divisas por entregar	4,229	22			
Dólares americanos	4,229	22			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	1,189,059	3,697,274			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición Larga	7,832,960	11,184,703			
Contratos Futuros sobre Renta Fija (Bonos)	1,508,811	1,237,334			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Extranjera	3,928,253	7,553,316			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	-	14,584			
Contratos de Opciones sobre Renta Variable Nacional	-	256			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	2,379,000	2,379,000			
Contratos de Opciones sobre Renta Variable Nacional	18,896	-			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición Corta	5,495,857	9,610,169			
Contratos Futuros sobre Renta Fija (Bonos)	1,130,849	1,039,228			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	1,951,702	3,398,586			
Contratos Futuros sobre Euro	545,484	1,678,351			
Contratos Futuros sobre Yen	13,429	19,852			
Contratos Futuros sobre Otras Divisas	365,382	1,105,313			
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 (menos) valía de:	\$ 2,108,917	\$ 5,238,713
Un valor de los activos netos de:	\$ 34,450,074	\$ 82,889,555
El precio de la acción de:	\$ 11.592254	\$ 10.965652

**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 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:

	2020	2019
<b>Ingresos por la Venta de Valores</b>	5,637,590	6,828,771
Intereses, Dividendos, Premios y Derechos	310,053	766,790
Resultados cambiarios / Otros productos	46,829	-3,545
Resultados por Intermediación con Instrumentos Financieros Derivados	-657,252	979,679
<b>Ingresos Netos</b>	<b>5,339,020</b>	<b>8,571,695</b>
<b>Costo de Ventas de Valores</b>	5,445,779	6,698,818
Gastos Generales	1,605	1,998
Comisiones Sobre Saldos	77,976	187,946
<b>Egresos Netos</b>	<b>5,525,360</b>	<b>6,888,762</b>
<b>Otros Resultados Integrales</b>	<b>-186,340</b>	<b>1,682,933</b>
Plus (Mínus) valías	-1,026,705	2,213,407
<b>UTILIDAD OPERACIÓN</b>	<b>-186,340</b>	<b>1,682,933</b>
<b>UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO</b>	<b>-1,213,045</b>	<b>-3,896,340</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 28 de Abril de 2020.