



# 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 DICIEMBRE DE:

(Cifras en miles de pesos)

|   | 2022              | 2021              |                                     | 2022              | 2021              |
|---|-------------------|-------------------|-------------------------------------|-------------------|-------------------|
| <b>ACTIVO</b>   |                   |                   | <b>PASIVO</b>                       |                   |                   |
| <b>DISPONIBLE</b>   |                   |                   | <b>OBLIGACIONES</b>                 | 29,403            | 69,730            |
| Bancos moneda nacional  | 2,287,865         | 733,612           | Divisas por entregar                | -                 | 66,142            |
| Bancos monedas extranjeras  | 1,207,790         | 1,497,051         | Acreedores                          | 25,600            | -                 |
| Divisas por recibir   | 3,495,655         | 2,230,663         | Provisiones para gastos             | 3,797             | 3,588             |
| <b>RESERVADOS</b>   | -                 | -                 |                                     |                   |                   |
| Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en divisas                                    | -                 | -                 |                                     |                   |                   |
| <b>INVERSIONES</b>  |                   |                   | <b>TOTAL PASIVO</b>                 | <b>29,403</b>     | <b>69,730</b>     |
| Inversión en valores de renta variable  | 11,930,085        | 11,629,409        |                                     |                   |                   |
| Plus (Minus) valía en valores de renta variable   | 107,328           | 1,681,211         |                                     |                   |                   |
| Inversión en instrumentos de deuda nacional de tasa real denominados en pesos y USD               | 19,663,760        | 16,129,663        |                                     |                   |                   |
| Plus (Minus) valía en instrumentos de deuda nacional de tasa real denominados en pesos y USD      | 2,659,860         | 3,559,697         |                                     |                   |                   |
| Inversión en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal denominados en pesos                  | 26,630,338        | 22,101,978        |                                     |                   |                   |
| Plus (Minus) valía en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal denominados en pesos         | -248,011          | -407,191          |                                     |                   |                   |
| Depósito Traspaso Bancario  | 28,331            | 40,909            |                                     |                   |                   |
| Plus (Minus) valía en inversión en el Depósito Traspaso Bancario                                  | 722,151           | 5                 |                                     |                   |                   |
| Inversión en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso          | -                 | 53,797            |                                     |                   |                   |
| Plus (Minus) valía en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso | -41,064           | 3,383             |                                     |                   |                   |
| Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas                                      | 792,178           | 423,121           |                                     |                   |                   |
| Plus (Minus) valía en instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas                | 155,415           | 80,940            |                                     |                   |                   |
| Inversión en FBRAS  | 204,817           | 287,617           |                                     |                   |                   |
| Plus (Minus) valía en inversión en FBRAS  | 13,708            | -11,565           |                                     |                   |                   |
| Aplicaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados                                       | 1,625,998         | 945,615           |                                     |                   |                   |
| Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)                                    | 7,969             | 146,651           |                                     |                   |                   |
| Inversión en títulos Fiduciarios  | 161,250           | 24,799            |                                     |                   |                   |
| Plus (Minus) valía en Inversión en Títulos Fiduciarios  | 1,582             | 3,252,345         |                                     |                   |                   |
| Inversión en Fondos Mutuos  | 502,472           | 466,597           |                                     |                   |                   |
| Plus (minus) valía en Fondos Mutuos   | 656,521           | 450,509           |                                     |                   |                   |
| Plus (minus) valía en Fondos Mutuos   | -87,266           | 11,298            |                                     |                   |                   |
| <b>DEUDORES DIVERSOS</b>  | <b>71,758,796</b> | <b>63,092,928</b> | <b>CAPITAL CONTRIBUIDO</b>          | <b>23,658,440</b> | <b>9,879,232</b>  |
| Liquidadora   | -                 | 872               | Capital Social pagado               | 25,629,587        | 20,982,172        |
| Dividendos o derechos por cobrar  | -                 | 3,042             | Prima en venta de acciones          | -1,971,147        | -11,102,940       |
| Intereses devengados sobre valores  | 218,307           | 149,472           |                                     |                   |                   |
| Reportes  | 340,211           | 1,080,477         |                                     |                   |                   |
| Reembolsos y otros intereses  | 2,644             | 515               |                                     |                   |                   |
|   | <b>461,182</b>    | <b>1,234,478</b>  | <b>CAPITAL GANADO</b>               | <b>48,968,459</b> | <b>50,987,623</b> |
|   |                   |                   | Resultados de ejercicios anteriores | 50,987,623        | 45,430,626        |
|   |                   |                   | Resultado del ejercicio             | -2,019,164        | 5,556,997         |
|   |                   |                   | <b>OTROS RESULTADOS INTEGRALES</b>  | <b>3,059,221</b>  | <b>5,591,484</b>  |
|   |                   |                   | PLUS (MINUS) VALÍAS                 | 3,059,221         | 5,591,484         |
| <b>TOTAL ACTIVO</b>   | <b>75,715,523</b> | <b>66,528,069</b> | <b>TOTAL CAPITAL CONTABLE</b>       | <b>75,686,120</b> | <b>66,458,339</b> |
|   |                   |                   | <b>TOTAL PASIVO Y CAPITAL</b>       | <b>75,715,523</b> | <b>66,528,069</b> |

## CUENTAS DE ORDEN

|   |            |            |   |                 |                 |
|---|------------|------------|---|-----------------|-----------------|
| Valores entregados en custodia  | 70,152,708 | 62,117,214 | Capital social autorizado                             | 1,000,000,100   | 1,000,000,100   |
| Garantías recibidas en custodia por Reportes                              | 240,254    | 1,080,887  | Acciones emitidas                                     | 208,233,011,885 | 208,233,011,885 |
| Bancos divisas en moneda extranjera                                       | 62,196     | 73,240     | Acciones en circulación posición propia               | 26,199,285      | 27,008,113      |
| Divisas americanas  | 61,344     | 72,499     | Acciones de Siferos posición de terceros              | 1               | 1               |
| Euro  | 170        | 169        | Acciones en circulación propiedad de los trabajadores | 5,310,726,349   | 4,342,172,300   |
| Otras Divisas   | 662        | 571        |   |                 |                 |
| Dólar Canadiense  | 662        | 571        |   |                 |                 |
| Divisas por entregar  | -          | 3,232      |   |                 |                 |
| Dólares americanos  | -          | 3,232      |   |                 |                 |
| Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios             | 1,013,411  | 953,834    |   |                 |                 |
| Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición Larga | 30,386,350 | 21,415,986 |   |                 |                 |
| Contratos Futuros sobre Renta Fija (Bonos)                                | 4,363,198  | 566,586    |   |                 |                 |
| Contratos Futuros sobre Renta Variable Extranjera                         | 20,454,285 | 16,673,282 |   |                 |                 |
| Contratos Futuros sobre Dólar Americano                                   | 5,051,914  | 3,754,113  |   |                 |                 |
| Contratos Futuros sobre Yenes   | 557,999    | 404,128    |   |                 |                 |
| Contratos de títulos Cuponales de Renta Variable Nacional                 | 18,996     | 18,996     |   |                 |                 |
| Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición Corta | 11,316,279 | 8,207,390  |   |                 |                 |
| Contratos Futuros sobre Renta Fija (Bonos)                                | 9,028,653  | 5,286,618  |   |                 |                 |
| Contratos Futuros sobre Euros   | 743,784    | 1,311,787  |   |                 |                 |
| Contratos Futuros sobre Otras Divisas                                     | 1,543,842  | 1,608,986  |   |                 |                 |

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

|                                   |               |               |
|-----------------------------------|---------------|---------------|
| Una plus (minus) valía de:        | \$ 3,059,221  | \$ 5,591,484  |
| Un valor de los activos netos de: | \$ 75,686,120 | \$ 66,458,339 |
| El precio de la acción de:        | \$ 14,181,595 | \$ 15,210,710 |

MARTHA BARRERA FERNÁNDEZ

Contador General de SIEFORE

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

C.P.C. ESTEBAN JOSÉ AILLOU PEÓN DEL VALLE

Comisario

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 16 de febrero de 2023.

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 Diciembre de:

|  | 2022              | 2021              |
|--|-------------------|-------------------|
| <b>Ingresos por la Venta de Valores</b>                              | 36,566,968        | 14,479,708        |
| Intereses, Dividendos, Premios y Derachos                            | 2,736,433         | 1,951,123         |
| Resultados cambiarios / Otros productos                              | -182,753          | 65,546            |
| Resultados por Intermediación con Instrumentos Financieros Derivados | -4,020,728        | 3,079,308         |
| <b>Ingresos Netos</b>  | <b>35,101,940</b> | <b>19,575,685</b> |
| <b>Costo de Ventas de Valores</b>                                    | 36,707,423        | 13,538,255        |
| Gastos Generales   | 14,805            | 9,933             |
| Comisiones Sobre Saldos  | 396,615           | 470,500           |
| Comisiones por gestión de Fondos Mutuos                              | 261               | 0                 |
| <b>Egresos Netos</b>   | <b>37,121,104</b> | <b>14,018,688</b> |
| <b>UTILIDAD OPERACIÓN</b>  | <b>-2,019,164</b> | <b>5,556,997</b>  |
| <b>Otros Resultados Integrales</b>                                   | <b>-2,532,262</b> | <b>32,522</b>     |
| Plus (Minus) valías  |                   |                   |
| <b>UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO</b>                               | <b>-4,551,426</b> | <b>5,589,519</b>  |

MARTHA BARRERA FERNÁNDEZ

Contador General de SIEFORE

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

C.P.C. ESTEBAN JOSÉ AILLOU PEÓN DEL VALLE

Comisario

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 16 de febrero de 2023.