



# Profuturo®

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

FONDO PROFUTURO SB 75-79, S.A. DE C.V.,

SOCIEDAD DE INVERSIÓN ESPECIALIZADA DE FONDOS PARA EL RETIRO

(antes Fondo Profuturo SB3, 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	1,230,827	1,420,196		2,562,935	448,496
· Bancos monedas extranjeras	1,226,086	2,715,349	Divisas por entregar		191
· Divisas por recibir	1,919,836	-	· Acreedores	231,393	433,590
	<b>4,376,729</b>	<b>3,535,545</b>	· Provisiones para gastos	2,931	14,715
<b>RESERVADOS</b>					
Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en divisas	7,551	-			
	<b>7,551</b>	-			
<b>INVERSIONES</b>			<b>TOTAL PASIVO</b>	<b>2,562,935</b>	<b>448,496</b>
Inversión en valores de renta variable	18,591,891	24,235,021			
Plus (Mínus) valia en valores de renta variable	553,836	3,093,190			
Inversión en instrumentos de deuda nacional de tasa real denominados en pesos	46,440,841	65,976,399			
Plus (Mínus) valia en instrumentos de deuda nacional de tasa real denominados en pesos y UDIS	6,832,821	7,996,495			
Inversión en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal denominados en pesos	36,842,719	61,550,199			
Plus (Mínus) valia en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal denominados en pesos	107,645	-976,596			
Deposito Traspaso Bancario	7,091	22,828	<b>CAPITAL CONTRIBUIDO</b>	<b>41,876,567</b>	<b>111,333,595</b>
Plus (Mínus) valia en inversión en el Depósito Traspaso Bancario	110	120	Capital Social pagado		85,759,356
Inversión en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	43,962	204,962	Prima en venta de acciones	-10,062,741	25,574,239
Plus (Mínus) valia en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	35,550	64,293			
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	565,193	948,421	<b>CAPITAL GANADO</b>	<b>66,151,751</b>	<b>58,155,461</b>
Plus (Mínus) valia en instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	109,370	140,198	Resultados de ejercicios anteriores	66,831,987	54,703,428
Inversión en FIBRAS	1,418,493	2,381,929	Resultado del ejercicio	-680,236	3,452,033
Plus (Mínus) valia en Inversión en FIBRAS	-376,419	-292,676			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	1,093,132	687,242			
Plus (Mínus) valia en Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	548	-			
Primas por ejercicio de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	800,924	917,203			
Plus (Mínus) valia en Inversión en valores extranjeros de deuda	139,912	189,528			
Inversión en títulos fiduciarios	6,794,846	8,077,568	<b>OTROS RESULTADOS INTEGRALES</b>	<b>7,985,945</b>	<b>11,609,114</b>
Plus (Mínus) valia en Inversión en valores extranjeros de deuda	139,912	189,528			
Inversión en títulos fiduciarios	785,180	1,504,773	<b>PLUS (MÍNUS) VALÍAS</b>	<b>7,985,945</b>	<b>11,609,114</b>
Plus (Mínus) valia en títulos fiduciarios	<b>110,575,468</b>	<b>176,592,997</b>			
<b>DEUDORES DIVERSOS</b>					
· Liquidadora	2,029,161	16,117			
Dividendos o derechos por cobrar	1,440	7,461			
Intereses devengados sobre valores	868,498	1,294,046			
Reportes	700,129	-			
Reembolsos y otros intereses	222	-			
	<b>3,817,450</b>	<b>1,418,124</b>			
			<b>TOTAL CAPITAL CONTABLE</b>	<b>116,014,263</b>	<b>181,098,170</b>
<b>TOTAL ACTIVO</b>	<b>118,577,198</b>	<b>181,546,666</b>	<b>TOTAL PASIVO Y CAPITAL</b>	<b>118,577,198</b>	<b>181,546,666</b>

**CUENTAS DE ORDEN**

Valores entregados en custodia	109,462,337	175,905,732	Capital social autorizado	1,000,000,100	1,000,000,100
Garantías recibidas en custodia por Reportes	700,367	-	Acciones emitidas	208,233,011,885	208,233,011,885
Garantías Recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	52,480	2,785	Acciones en circulación posición propia	79,108,469	128,069,484
Bancos divisas en moneda extranjera	51,266	108,943	Acciones de Siefaros posición de terceros	1	1
Dólares americanos	280	-	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	10,736,368,998	17,729,857,828
Euro	933	294			
Otras Divisas	953	294			
Dólar Canadiense	853	294			
Divisas por recibir	81,748	-			
Dólares americanos	81,748	-			
Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en moneda extranjera	302	-			
Dólares americanos	302	-			
Divisas por entregar	99,154	10			
Dólares americanos	99,154	10			
Compromisos fiduciosos por la adquisición de títulos fiduciarios	3,748,564	6,967,517			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición Larga	11,165,129	13,149,144			
Contratos Futuros sobre Renta Fija (Bonos)	2,964,643	2,431,241			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	54,504	108,485			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Extranjera	-	10,229,248			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	-	53,511			
Dólares americanos	-	560			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	326,000	326,000			
Contratos de Opciones sobre Renta Variable Nacional	48,277	-			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición Corta	11,393,720	14,441,873			
Contratos Futuros sobre Renta Fija (Bonos)	2,522,584	2,321,323			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	5,265,083	6,239,822			
Contratos Futuros sobre Euro	1,518,482	2,935,056			
Contratos Futuros sobre Yen	429,673	696,540			
Contratos Futuros sobre Otras Divisas	1,062,897	2,016,933			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	326,000	326,000			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:  
 Una plus (minus) valia de: \$ 7,985,945 \$ 11,609,114  
 Un valor de los activos netos de: \$ 116,014,264 \$ 181,098,170  
 El precio de la acción de: \$ 10.726689 \$ 10.141052

**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 28 de Abril de 2020.

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

FONDO PROFUTURO SB 75-79, S.A. DE C.V.,

SOCIEDAD DE INVERSIÓN ESPECIALIZADA DE FONDOS PARA EL RETIRO

(antes Fondo Profuturo SB3, 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>	16,110,660	20,110,170
Intereses, Dividendos, Premios y Derachos	1,101,492	1,758,630
Resultados por Intermediación con Instrumentos Financieros Derivados	-2,156,731	1,467,083
<b>Ingresos Netos</b>	<b>15,310,123</b>	<b>23,316,046</b>
<b>Egresos Netos</b>	<b>15,990,359</b>	<b>19,864,013</b>
Costo de Ventas de Valores	15,719,347	19,438,486
Gastos Generales	3,210	3,926
Comisiones Sobre Saldos	267,802	421,601
<b>UTILIDAD OPERACIÓN</b>	<b>-680,236</b>	<b>3,452,033</b>
<b>Otros Resultados Integrales</b>	<b>-2,921,786</b>	<b>4,352,894</b>
Plus (Mínus) valias		
<b>UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO</b>	<b>-3,602,022</b>	<b>7,804,927</b>

**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 28 de Abril de 2020.