

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 |
|---|-------------------|-------------------|-------------------------------------|-------------------|-------------------|
| ACTIVO | | | PASIVO | | |
| DISPONIBLE | | | | | |
| 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 |
| | 1,480,264 | 3,254,770 | Provisiones para gastos | 872 | 6,732 |
| RESERVADOS | | | | 403,905 | 192,098 |
| Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en divisas | - | - | | | |
| | | | TOTAL PASIVO | 403,905 | 192,098 |
| INVERSIONES | | | | | |
| Inversión en valores de renta variable | 5,719,818 | 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 | CAPITAL CONTABLE | | |
| 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 | CAPITAL CONTRIBUIDO | -8,633,117 | 39,344,643 |
| Depósito Traspaso Bancario | 9,233 | 3,034 | Capital Social pagado | 14,271,602 | 36,300,769 |
| Plus (Mínus) valía en inversión en el Depósito Traspaso Bancario | 143 | 16 | Prima en venta de acciones | -23,904,719 | 3,043,874 |
| Inversión en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso | 9,845 | 110,578 | | | |
| Plus (Mínus) valía en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso | 7,171 | 29,475 | CAPITAL GANADO | 41,974,274 | 38,306,199 |
| Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas | 444,911 | 647,897 | Resultados de ejercicios anteriores | 42,160,614 | 36,823,266 |
| Plus (Mínus) valía en instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas | 51,922 | 91,734 | Resultados del ejercicio | -186,340 | 1,682,933 |
| Inversión en FIBRAS | 362,853 | 1,034,195 | | | |
| Plus (Mínus) valía en Inversión en FIBRAS | -89,088 | -133,917 | OTROS RESULTADOS INTEGRALES | 2,108,917 | 5,238,713 |
| Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados | 531,844 | 481,506 | | | |
| Primas por ejercicio de Instrumentos Financieros Derivados (OTC) | 215 | 321,424 | PLUS (MÍNUS) VALÍAS | 2,108,917 | 5,238,713 |
| Inversión en valores extranjeros de deuda | 163,500 | 30,119 | | | |
| 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 | | | |
| | 32,425,143 | 79,265,704 | | | |
| DEUDORES DIVERSOS | | | | | |
| 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 | - | | | |
| | 948,572 | 621,179 | TOTAL CAPITAL CONTABLE | 34,450,074 | 82,889,555 |
| TOTAL ACTIVO | 34,853,979 | 83,081,653 | TOTAL PASIVO Y CAPITAL | 34,853,979 | 83,081,653 |

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 Siefores posición de tenedores | 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 | 7,553,516 | | | |
| 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 | 1,878,351 | | | |
| Contratos Futuros sobre Yen | 13,429 | 19,892 | | | |
| 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: | \$ 11,592,254 | \$ 10,965,652 |

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 |
|--|-------------------|-------------------|
| Ingresos por la Venta de Valores | 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 |
| Ingresos Netos | 5,339,020 | 8,571,695 |
| Costo de Ventas de Valores | 5,445,779 | 6,698,818 |
| Gastos Generales | 1,605 | 1,998 |
| Comisiones Sobre Saldos | 77,976 | 187,946 |
| Egresos Netos | 5,525,360 | 6,888,762 |
| Otros Resultados Integrales | -186,340 | 1,682,933 |
| Plus (Mínus) valías | -1,026,705 | 2,213,407 |
| UTILIDAD OPERACIÓN | -186,340 | 1,682,933 |
| UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO | -1,213,045 | -3,896,340 |

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.