



# 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)

|  | 2021               | 2020               |                                     | 2021               | 2020               |
|--|--------------------|--------------------|-------------------------------------|--------------------|--------------------|
| <b>ACTIVO</b>  |                    |                    | <b>PASIVO</b>                       |                    |                    |
| <b>DISPONIBLE</b>  |                    |                    |                                     | 372,605            | 2,562,937          |
| Bancos moneda nacional   | 718,413            | 1,230,827          | Divisas por entregar                | -                  | 2,328,612          |
| Bancos monedas extranjeras   | 3,880,362          | 1,226,066          | Acreedores                          | 356,073            | 231,393            |
| Divisas por recibir  | 4,598,778          | 4,376,728          | Provisiones para gastos             | 16,532             | 2,932              |
| <b>RESERVADOS</b>  |                    |                    |                                     |                    |                    |
| Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en divisas                                     | -                  | 7,551              |                                     |                    |                    |
|  | -                  | 7,551              |                                     |                    |                    |
| <b>INVERSIONES</b>   |                    |                    | <b>TOTAL PASIVO</b>                 | <b>372,605</b>     | <b>2,562,937</b>   |
| Inversión en valores de renta variable   | 19,977,557         | 18,591,891         |                                     |                    |                    |
| Plus (Mínus) valías en valores de renta variable   | 4,740,987          | 553,836            |                                     |                    |                    |
| Inversión en instrumentos de deuda nacional de tasa real denominados en pesos y USD                | 51,984,912         | 46,440,842         |                                     |                    |                    |
| Plus (Mínus) valías en instrumentos de deuda nacional de tasa real denominados en pesos y USD      | 10,436,946         | 6,532,521          | <b>CAPITAL CONTABLE</b>             |                    |                    |
| Inversión en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal denominados en pesos                   | 38,169,763         | 26,842,719         |                                     |                    |                    |
| Plus (Mínus) valías en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal denominados en pesos         | -329,214           | 107,645            |                                     |                    |                    |
| Deposito Traspaso Bancario   | 4,623              | 7,091              | <b>CAPITAL CONTRIBUIDO</b>          | <b>50,574,291</b>  | <b>41,876,567</b>  |
| Plus (Mínus) valías en inversión en el Depósito Traspaso Bancario                                  | 127                | 110                | Capital Social pagado               | 55,365,120         | 51,939,308         |
| Inversión en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso           | 153,776            | 43,845             | Prima en venta de acciones          | -4,790,919         | -10,062,741        |
| Plus (Mínus) valías en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso | 21,904             | 35,550             |                                     |                    |                    |
| Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas                                       | 238,836            | 555,193            |                                     |                    |                    |
| Plus (Mínus) valías en instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas                | 32,851             | 138,370            | <b>CAPITAL GANADO</b>               | <b>78,447,335</b>  | <b>66,151,751</b>  |
| Inversión en FBRAS   | 1,345,001          | 1,418,493          | Resultados de ejercicios anteriores | 75,866,306         | 66,831,987         |
| Plus (Mínus) valías en inversión en FBRAS  | -222,829           | -376,479           | Resultados del ejercicio            | 3,581,029          | -680,236           |
| Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados  | 1,647,070          | 1,093,132          |                                     |                    |                    |
| Prima por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)                                      | 18                 | 548                |                                     |                    |                    |
| Inversión en valores extranjeros de deuda  | 838,708            | 800,504            |                                     |                    |                    |
| Plus (Mínus) valías en inversión en valores extranjeros de deuda                                   | 188,520            | 138,912            |                                     |                    |                    |
| Inversión en Fideicomisos  | 9,270,877          | 6,794,646          |                                     |                    |                    |
| Plus (Mínus) valías en Fideicomisos  | 696,157            | 765,180            | <b>OTROS RESULTADOS INTEGRALES</b>  | <b>15,535,828</b>  | <b>7,865,945</b>   |
|  | <b>139,196,800</b> | <b>110,575,469</b> |                                     |                    |                    |
| <b>DEUDORES DIVERSOS</b>   |                    |                    | <b>PLUS (MÍNUS) VALÍAS</b>          | <b>15,535,828</b>  | <b>7,865,945</b>   |
| Liquidados   | 327                | 2,029,162          |                                     |                    |                    |
| Dividendos o derechos por cobrar   | 16,287             | 1,440              | <b>TOTAL CAPITAL CONTABLE</b>       | <b>145,557,364</b> | <b>116,014,263</b> |
| Intereses devengados sobre valores   | 1,116,812          | 885,489            |                                     |                    |                    |
| Reportes   | 1,000,569          | 700,129            |                                     |                    |                    |
| Reembolsos y otros intereses   | 399                | 222                |                                     |                    |                    |
|  | <b>2,114,384</b>   | <b>3,617,451</b>   |                                     |                    |                    |
| <b>TOTAL ACTIVO</b>  | <b>145,929,969</b> | <b>118,577,200</b> | <b>TOTAL PASIVO Y CAPITAL</b>       | <b>145,929,969</b> | <b>118,577,200</b> |

## CUENTAS DE ORDEN

|   |                |                |   |                 |                 |
|---|----------------|----------------|---|-----------------|-----------------|
| Valores entregados en custodia  | 137,549,730    | 109,482,337    | Capital social autorizado                             | 1,000,000,100   | 1,000,000,100   |
| Garantías recibidas en custodia por Reportes                              | 1,000,955      | 700,387        | Acciones emitidas                                     | 208,233,011,885 | 208,233,011,885 |
| Bancos divisas en moneda extranjera                                       | 190,059        | 52,460         | Acciones en circulación posición propia               | 70,859,230      | 79,108,469      |
| Dólares americanos  | 188,474        | 51,266         | Acciones de Siefore posición de tenores               | 1               | 1               |
| Euro  | 258            | 260            | Acciones en circulación propiedad de los trabajadores | 11,457,985,244  | 10,736,388,998  |
| Otras Divisas   | 1,338          | 933            |   |                 |                 |
| Dólar Canadiense  | 1,338          | 933            |   |                 |                 |
| Divisas por recibir   | -              | 81,748         |   |                 |                 |
| Dólares americanos  | -              | 81,748         |   |                 |                 |
| Dólares americanos  | -              | 322            |   |                 |                 |
| Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en moneda extranjera  | -              | 322            |   |                 |                 |
| Dólares americanos  | -              | 99,154         |   |                 |                 |
| Divisas por entregar  | -              | 99,154         |   |                 |                 |
| Dólares americanos  | -              | 99,154         |   |                 |                 |
| Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios             | 3,220,489      | 3,748,524      |   |                 |                 |
| Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición Larga | 28,479,704     | 11,165,129     |   |                 |                 |
| Contratos Futuros sobre Renta Fija (Bonos)                                | 403,696        | 2,964,543      |   |                 |                 |
| Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional                           | 258            | 260            |   |                 |                 |
| Contratos Futuros sobre Renta Variable Extranjera                         | 23,321,184     | 7,771,805      |   |                 |                 |
| Contratos Futuros sobre Dólar Americano                                   | 2,138,145      | -              |   |                 |                 |
| Contratos Futuros sobre Yen   | 185,115        | -              |   |                 |                 |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos                               | 326,000        | 326,000        |   |                 |                 |
| Contratos de Títulos Opcionales de Renta Variable Nacional                | 48,277         | 48,277         |   |                 |                 |
| Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición Corta | 10,267,982     | 11,393,720     |   |                 |                 |
| Contratos Futuros sobre Renta Fija (Bonos)                                | 4,699,535      | 2,522,584      |   |                 |                 |
| Contratos Futuros sobre Dólar Americano                                   | -              | 5,505,083      |   |                 |                 |
| Contratos Futuros sobre Euro  | 1,662,065      | 1,518,462      |   |                 |                 |
| Contratos Futuros sobre Yen   | 3,550,362      | 426,873        |   |                 |                 |
| Contratos Futuros sobre Tasa Variable en Pesos                            | 326,000        | 1,092,897      |   |                 |                 |
|   |                | 326,000        |   |                 |                 |
| La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:            |                |                |   |                 |                 |
| Una plus (mínus) valía de:  | \$ 15,535,828  | \$ 7,865,945   |   |                 |                 |
| Un valor de los activos netos de:   | \$ 145,557,364 | \$ 116,014,264 |   |                 |                 |
| El precio de la acción de:  | \$ 12,625,495  | \$ 10,726,689  |   |                 |                 |

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 21 de Abril de 2021.

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:

|  | 2021              | 2020              |
|--|-------------------|-------------------|
| <b>Ingresos por la Venta de Valores</b>                              | <b>10,918,317</b> | <b>16,110,660</b> |
| Intereses, Dividendos, Premios y Derechos                            | 1,160,589         | 1,101,492         |
| Resultados cambiarios / Otros productos                              | 133,202           | 254,702           |
| Resultados por Intermediación con Instrumentos Financieros Derivados | 1,531,418         | -2,156,731        |
| <b>Ingresos Netos</b>  | <b>13,743,526</b> | <b>15,310,123</b> |
| <b>Costo de Ventas de Valores</b>                                    | <b>9,854,963</b>  | <b>15,719,347</b> |
| Gastos Generales   | 5,229             | 3,210             |
| Comisiones Sobre Saldos  | 302,305           | 267,802           |
| <b>Egresos Netos</b>   | <b>10,162,497</b> | <b>15,990,359</b> |
| <b>UTILIDAD OPERACIÓN</b>  | <b>3,581,029</b>  | <b>-680,236</b>   |
| <b>Otros Resultados Integrales</b>                                   | <b>-2,761,503</b> | <b>-2,921,786</b> |
| Plus (Mínus) valías  |                   |                   |
| <b>UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO</b>                               | <b>819,526</b>    | <b>-3,602,022</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 21 de Abril de 2021.