

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 DICIEMBRE DE:

(Cifras en miles de pesos)

| | 2021 | 2020 | | 2021 | 2020 |
|---|--------------------|--------------------|-------------------------------------|--------------------|--------------------|
| ACTIVO | | | PASIVO | | |
| DISPONIBLE | | | OBLIGACIONES | 125,499 | 123,616 |
| Banco moneda nacional | 793,608 | 674,188 | Divisas por entregar | 116,596 | 88,718 |
| Bancos monedas extranjeras | 2,282,634 | 3,239,354 | Acreedores | - | 21,625 |
| Divisas por recibir | <u>3,876,240</u> | <u>3,913,542</u> | Provisiones para gastos | 8,903 | 13,273 |
| RESERVADOS | | | | | |
| Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en divisas | - | 10,908 | | | |
| | | <u>10,908</u> | | | |
| INVERSIONES | | | TOTAL PASIVO | 125,499 | 123,616 |
| Inversión en valores de renta variable | 23,889,987 | 19,507,181 | | | |
| Plus (Minus) valías en valores de renta variable | 3,743,979 | 3,543,226 | | | |
| Inversión en instrumentos de deuda nacional de tasa real denominados en pesos | 51,467,415 | 50,721,938 | | | |
| Plus (Minus) valía en instrumentos de deuda nacional de tasa real denominados en pesos y USDS | 19,850,061 | 12,099,632 | | | |
| Inversión en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal denominados en pesos | 51,861,911 | 32,574,492 | CAPITAL CONTABLE | | |
| Plus (Minus) valía en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal denominados en pesos | -1,147,157 | 1,616,139 | | | |
| Depósito Traspaso Bancario | 37,334 | 4,604 | CAPITAL CONTRIBUIDO | 57,376,228 | 48,152,693 |
| Plus (Minus) valía en inversión en el Depósito Traspaso Bancario | 5 | 3 | Capital Social pagado | 57,847,131 | 54,454,728 |
| Inversión en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso | 150,331 | 428,002 | Prima en venta de acciones | -470,903 | -6,302,035 |
| Plus (Minus) valía en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso | 11,840 | 14,025 | | | |
| Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas | 428,444 | 555,193 | CAPITAL GANADO | 89,630,004 | 75,866,306 |
| Plus (Minus) valía en instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas | 66,154 | 165,197 | Resultados de ejercicios anteriores | 75,866,306 | 66,831,987 |
| Inversión en FIBRAS | 1,124,305 | 1,427,607 | Resultado del ejercicio | 13,763,698 | 9,034,319 |
| Plus (Minus) valía en Inversión en FIBRAS | -25,154 | -213,742 | | | |
| Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados (OTC) | 1,098,964 | 1,302,194 | OTROS RESULTADOS INTEGRALES | 17,889,337 | 18,297,331 |
| Primas por ejercer de Instrumentos Financieros Derivados (OTC) | 26 | 30 | | | |
| Inversión en instrumentos de deuda | 724,728 | 800,624 | PLUS (MINUS) VALÍAS | 17,889,037 | 18,297,331 |
| Plus (Minus) valía en inversión en valores extranjeros de deuda | 11,891 | 230,752 | | | |
| Inversión en Títulos Fiduciarios | 10,618,659 | 8,540,789 | | | |
| Plus (minus) valías en Títulos Fiduciarios | 1,555,551 | 942,099 | | | |
| Inversión en Fondos Mutuos | 921,138 | - | | | |
| Plus (minus) valía en Fondos Mutuos | 22,817 | - | | | |
| | 160,610,389 | 137,010,284 | | | |
| DEUDORES DIVERSOS | | | TOTAL CAPITAL CONTABLE | 164,895,269 | 142,316,330 |
| Liquidados | 2,229 | 448 | | | |
| Dividendos o derechos por cobrar | 474,040 | 403,951 | TOTAL PASIVO Y CAPITAL | 165,020,768 | 142,439,946 |
| Intereses devengados sobre valores | 850,375 | 1,100,515 | | | |
| Reportes | 907 | 318 | | | |
| Reembolsos y otros intereses | 1,334,139 | 1,586,232 | | | |
| | | | | | |
| TOTAL ACTIVO | 165,020,768 | 142,439,946 | | | |

CUENTAS DE ORDEN

| | | | | | |
|---|-------------|-------------|---|-----------------|-----------------|
| Valores entregados en custodia | 158,911,425 | 136,658,070 | Capital social autorizado | 1,000,000,100 | 1,000,000,100 |
| Garantías recibidas en custodia por Reportes | 951,096 | 1,100,135 | Acciones emitidas | 208,233,011,885 | 208,233,011,885 |
| Bancos divisas en moneda extranjera | 111,853 | 162,919 | Acciones en circulación posición propia | 73,973,245 | 72,216,997 |
| Divisas americanas | 109,860 | 181,422 | Acciones de Siferos posición de terceros | 1 | 1 |
| Euro | 257 | 259 | Acciones en circulación propiedad de los trabajadores | 11,971,707,827 | 11,267,063,890 |
| Otras Divisas | 1,736 | 1,238 | | | |
| Dólar Canadiense | 1,736 | 548 | | | |
| Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en moneda extranjera | - | 548 | | | |
| Divisas americanas | - | 4,456 | | | |
| Divisas por entregar | 5,687 | 4,456 | | | |
| Dólares americanos | 5,687 | 1,298 | | | |
| Compromisos futuros para la adquisición de títulos fiduciarios | 2,918,311 | 3,380,852 | | | |
| Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición Larga | 35,785,053 | 18,441,350 | | | |
| Contratos Futuros sobre Renta Fija (Bonos) | 1,451,068 | - | | | |
| Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional | 60,349 | 51,591 | | | |
| Contratos Futuros sobre Renta Variable Extranjera | 29,750,560 | 17,388,773 | | | |
| Contratos Futuros sobre Dólar Americano | 4,252,312 | 522,178 | | | |
| Contratos Futuros sobre Títulos | 242,477 | 104,581 | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos | 48,277 | 326,000 | | | |
| Contratos de títulos Coponales de Renta Variable Nacional | 19,102,887 | 67,146,337 | | | |
| Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición Corta | 13,124,711 | 2,317,335 | | | |
| Contratos Futuros sobre Renta Fija (Bonos) | 2,756,828 | 2,106,135 | | | |
| Contratos Futuros sobre Euros | 3,310,550 | 1,996,867 | | | |
| Contratos Futuros sobre Otras Divisas | - | 326,000 | | | |
| Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos | - | - | | | |

| | | | | | |
|--|----------------|----------------|--|--|--|
| La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó: | | | | | |
| Una plus (minus) valía de: | \$ 17,889,037 | \$ 18,297,331 | | | |
| Un valor de los activos netos de: | \$ 164,895,269 | \$ 142,316,330 | | | |
| El precio de la acción de: | \$ 13,689,916 | \$ 12,550,748 | | | |

MARATHA BARRERA FERNÁNDEZ

Contador General de SIFORE

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

C. P. GUILLERMO BABATZ GARCÍA

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 24 de febrero de 2022.

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 Diciembre de:

| | 2021 | 2020 |
|--|-------------------|-------------------|
| Ingresos por la Venta de Valores | 40,285,874 | 51,155,595 |
| Intereses, Dividendos, Premios y Derachos | 5,636,326 | 4,645,227 |
| Resultados cambiarios / Otros productos | 143,981 | -350,857 |
| Resultados por Intermediación con Instrumentos Financieros Derivados | 6,210,662 | 2,642,081 |
| | 52,184,843 | 58,062,046 |
| Ingresos Netos | 52,184,843 | 58,062,046 |
| Costo de Ventas de Valores | 13,136,928 | 47,837,557 |
| Gastos Generales | 19,450 | 14,609 |
| Comisiones Sobre Saldos | 1,264,767 | 1,175,561 |
| | 14,421,145 | 49,027,727 |
| Egresos Netos | 14,421,145 | 49,027,727 |
| Otros Resultados Integrales | 13,763,698 | 9,034,319 |
| Plus (Minus) valías | -408,294 | 7,389,601 |
| | 13,355,404 | 16,423,920 |
| UTILIDAD OPERACIÓN | 13,355,404 | 16,423,920 |
| UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO | 13,355,404 | 16,423,920 |

MARATHA BARRERA FERNÁNDEZ

Contador General de SIFORE

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

C. P. GUILLERMO BABATZ GARCÍA

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 24 de febrero de 2022.