

Informe anual 2021

Sesión de Comité Técnico
29 de abril de 2022

- De conformidad con la Ley del Fondo y su Contrato Constitutivo, corresponde al Comité Técnico analizar y, en su caso, aprobar el informe anual que le presente el Coordinador Ejecutivo (artículo 8, fracción II, inciso a), numeral 5, de la Ley del Fondo y cláusulas Décima, fracción I, inciso e), y Décima Cuarta, fracción IV, de su Contrato Constitutivo).
- Con base en lo anterior, se somete a consideración del Comité Técnico el informe anual 2021.

Administración de los ingresos petroleros

I

Administración de la Reserva del Fondo

II

Administración de los aspectos financieros de los Contratos

III

Administración del Fondo

IV

a. Ingresos por asignaciones

- En 2021, el Fondo recibió por parte de Pemex, en su carácter de asignatario, el entero de los derechos de extracción y de exploración de hidrocarburos, así como por la utilidad compartida por un total de 337,988 millones de pesos (mdp).
- Los recursos recibidos por el DUC representaron el 78.7% de los ingresos provenientes de las asignaciones, mientras que el DEXT y DEXP representaron el 20.9% y el 0.4%, respectivamente.

Ingresos recibidos por asignaciones (Cifras en millones de pesos)

Concepto	2020	2021	$\Delta\%$ (2021 vs. 2020)
Derecho por la Utilidad Compartida	152,170	265,884	75%
Derecho de Extracción de Hidrocarburos	35,971	70,693	97%
Derecho de Exploración de Hidrocarburos	1,058	1,412	33%
Total	189,200	337,988	79%

b. Ingresos por Contratos

- El Fondo recibió en 2021 el pago de las siguientes contraprestaciones a favor del Estado:

Ingresos recibidos por contratos (Cifras en millones de pesos)

Cuota exploratoria	1,483
Total	1,483

(Cifras en millones de dólares)

Regalía base	39
Regalía adicional	111
Penas convencionales	1
Total	151

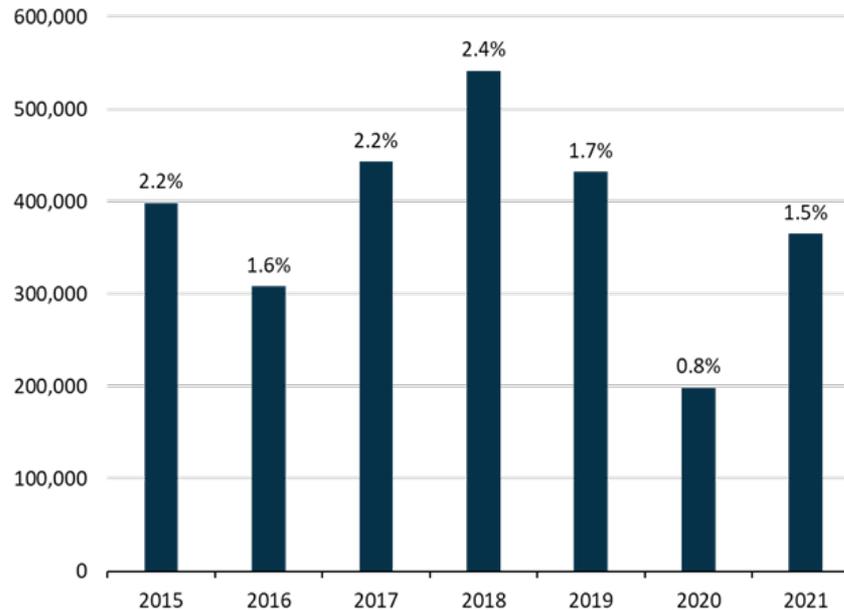
Ingresos netos de comercialización para la producción comercial regular	1,114
Total	1,114

Nota: Los totales pueden no coincidir debido al redondeo de las cifras.

c. Transferencias realizadas a la Tesofe y a los destinos previstos en la Ley del Fondo

El Fondo realizó las transferencias ordinarias de los recursos recibidos del asignatario, los contratistas y por las ventas netas de hidrocarburos que efectuó el comercializador del Estado, las cuales ascendieron a 364,895 mdp, lo que representó un incremento del 84% respecto a lo transferido en 2020 y fue equivalente al 1.5% del PIB estimado en los CGPE 2021.

Transferencias ordinarias
(Cifras en millones de pesos y como porcentaje del PIB)



Administración de los ingresos petroleros

I

Administración de la Reserva del Fondo

II

Administración de los aspectos financieros de los
Contratos

III

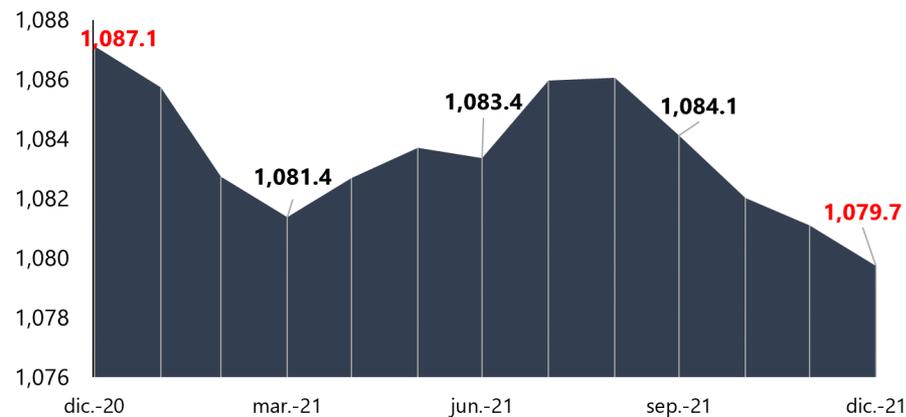
Administración del Fondo

IV

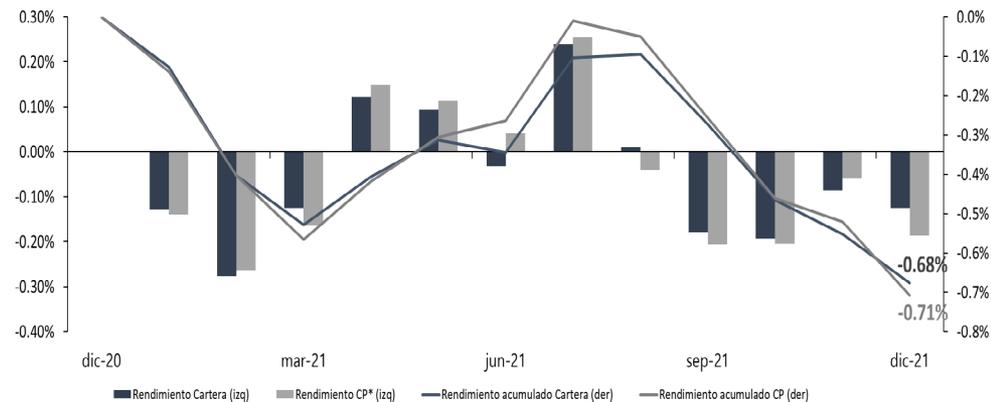
II. Administración de la Reserva del Fondo

- Al 31 de diciembre de 2021 el valor de la Reserva ascendió a 1,079.7 millones de dólares (mdd) lo que representó un rendimiento anual de -0.7%, superando al rendimiento de la cartera parámetro por 3 puntos base.

Valor acumulado de la Reserva en 2021
(Cifras en millones de dólares)



Rendimiento mensual y acumulado de las carteras en 2021
(Porcentaje)



* CP: Cartera Parámetro

II. Administración de la Reserva del Fondo

- El activo que tuvo la mayor contribución al desempeño de la cartera de inversión respecto de la parámetro fue el de divisas, lo que compensó las pérdidas registradas en los bonos corporativos y en las notas a rendimiento en el sector de 10 años.

Diferencia en rendimientos entre la Cartera de Inversión y la Cartera Parámetro (Cifras en puntos base)

	Asignación de activos	Selección de instrumentos	Costos de transacción	Efecto por Divisas	Total por atribución
TOTAL	-6	2	-2	10	3
Notas a descuento y Efectivo	-1	0	0	0	-1
Bonos corporativos	-5	0	1	0	-5
Notas a rendimiento (1-3 años)	0	0	0	0	0
Notas a rendimiento (10 años)	-1	0	-1	0	-2
Agencias	0	2	0	0	1
Divisas	2	0	-2	10	10

Los efectos de atribución son: i) asignación de activos, el cual corresponde al valor agregado de ponderar un sector de manera diferente al benchmark; ii) selección de instrumentos, rendimiento agregado al invertir en instrumentos distintos a los de la cartera parámetro y iii) costos de transacción, rendimiento generado al operar a un precio por encima o por debajo del precio de cierre.

La Política de Inversión y Administración de Riesgos del Fondo establece una calificación crediticia mínima para los valores de renta fija que pueden conformar la cartera de inversión, así como para las contrapartes con las que el Fondo puede realizar operaciones financieras. Al respecto, el Fondo cumplió a lo largo del año con dichos lineamientos y tanto los instrumentos de inversión, como las contrapartes con las cuales llevó a cabo sus operaciones se adecuaron en todo momento a las referidas calificaciones.

Composición de la cartera de inversión por calificación crediticia al cierre de diciembre

AAA	AA	A	BBB y menos	Efectivo
80%	3%	8%	0%	9%

Administración de los ingresos petroleros

I

Administración de la Reserva del Fondo

II

Administración de los aspectos financieros de los Contratos

III

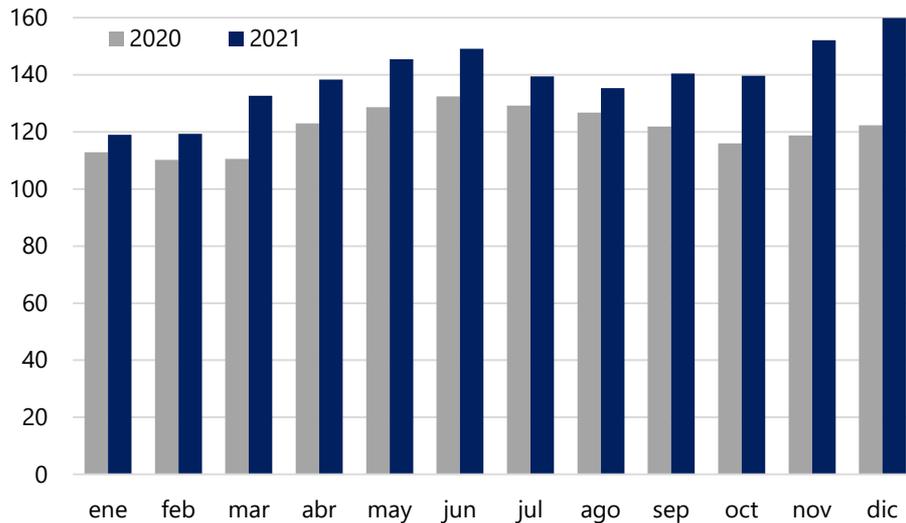
Administración del Fondo

IV

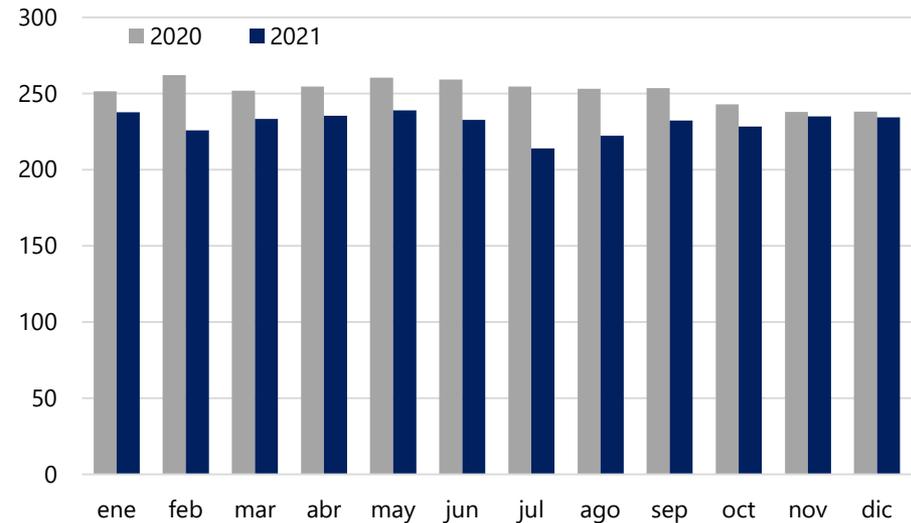
III. Administración de los aspectos financieros de los Contratos

- Al cierre del 2021, el Fondo tenía a su cargo la administración de los aspectos financieros de 111 contratos, de los cuales 35 operan bajo la modalidad de producción compartida y los restantes 76 bajo la modalidad de licencia.
 - ✓ Para 35 contratos se calcularon contraprestaciones asociadas a la producción de hidrocarburos.
- Al cierre del año se alcanzó un máximo en la producción de hidrocarburos líquidos de 160 mil barriles diarios (mbd).

Producción de hidrocarburos líquidos de los contratos
(Cifras en miles de barriles diarios)



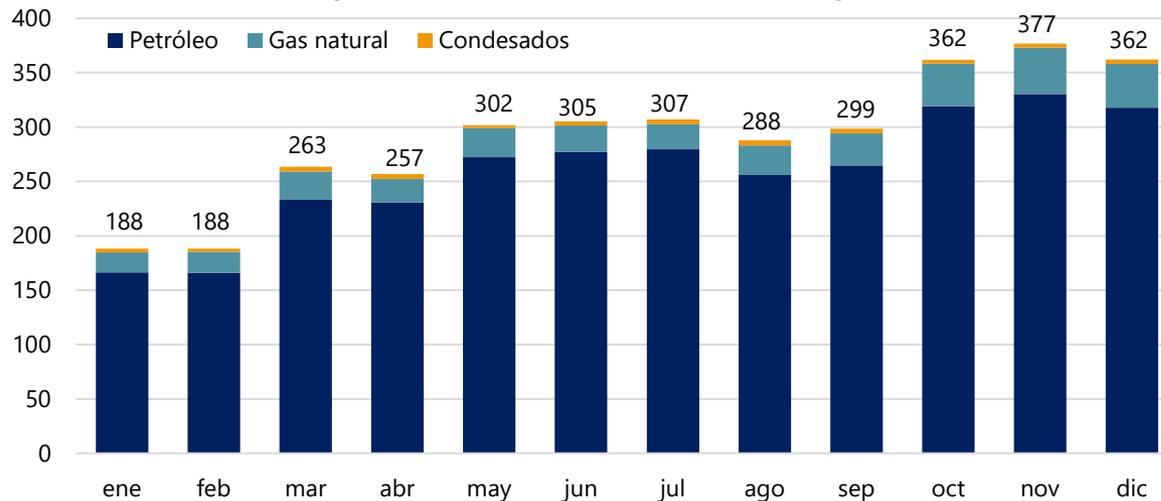
Producción de gas natural de los contratos
(Cifras en millones de pies cúbicos diarios)



III. Administración de los aspectos financieros de los Contratos

- El valor de la producción de hidrocarburos ascendió a 3,498 mdd, un incremento de 109% con respecto a 2020.
 - ✓ El petróleo representó el 89% del total.
 - ✓ El incremento se explica principalmente por mayores precios, de los que destaca el petróleo que aumentó 82%.

Valor de los hidrocarburos producidos
(Cifras en millones de dólares)



III. Administración de los aspectos financieros de los Contratos

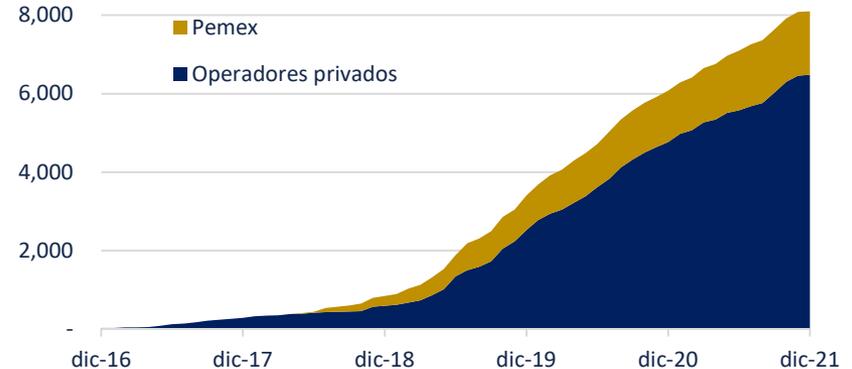
El monto acumulado de inversiones hasta el 31 de diciembre de 2021 asciende a 8,098 mdd.

- ✓ El 85% corresponde a inversiones de operadores privados.

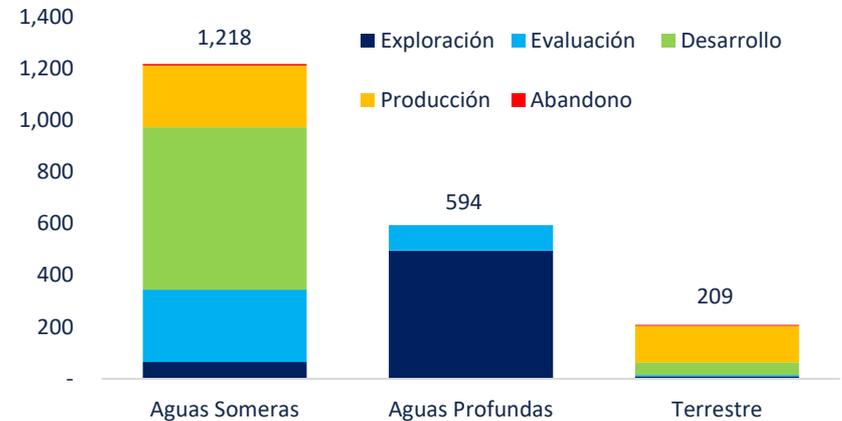
Durante 2021, se registraron inversiones por 2,020 mdd.

- ✓ El 34% se destinó a actividades de desarrollo y 28% de exploración.
- ✓ Destacan las sub-actividades de perforación de pozos y construcción de instalaciones que en conjunto representan el 58% del total.

Inversiones acumuladas por tipo de operador
(Cifras en millones de dólares)



Inversiones por tipo de campo y actividad
(Cifras en millones de dólares)



III. Administración de los aspectos financieros de los Contratos

Como parte de los procesos para dar cumplimiento a la administración financiera de los contratos, se llevó a cabo:

- La emisión de 583 notificaciones a contratistas y a autoridades para informar sobre la conciliación entre el cálculo de contraprestaciones y el pago recibido:
- La emisión de 95 certificados de pago (47 por contratos de licencia y el restante de producción compartida) para los contratos en cumplimiento de sus obligaciones de pago.
- La publicación de 4,276 series estadísticas cada mes, informando sobre el monto de inversión, volúmenes de producción, precios, cálculo de contraprestaciones e ingresos de los contratos en cumplimiento a los establecido en ley.
- La aplicación de 29 procesos de ajustes derivados de las labores de verificación de la SHCP y cambios solicitados por la CNH.
- La recepción y gestión de 112,177 documentos de soporte sobre las actividades de contratistas para las actividades de verificación de la SHCP.

Administración de los ingresos petroleros

I

Administración de la Reserva del Fondo

II

Administración de los aspectos financieros de los Contratos

III

Administración del Fondo

IV

a. Honorarios fiduciarios pagados a Banco de México

El Fondo cubrió al Banco de México honorarios fiduciarios por 101 mdp para cubrir los gastos necesarios para la operación del fideicomiso.

Lo anterior en línea con el gasto de operación autorizado por el Comité Técnico por 117,364,754 pesos para 2021.

b. Transparencia y rendición de cuentas

Información relativa al artículo 73, fracción V, de la Ley Federal de Transparencia y Acceso a la Información Pública (LFTAIP) y 77 de la Ley General de Transparencia y Acceso a la Información Pública (LGTAIP)

El Fondo cumplió en tiempo y forma con su obligación de publicar la información prevista en el artículo 73, fracción V, de la LFTAIP, así como de poner a disposición del público y mantener actualizada y accesible la información señalada en el artículo 77 de la LGTAIP, obteniendo un puntaje de cien (100) puntos porcentuales en el Índice Global de Cumplimiento en Portales de Transparencia del INAI.

c. Fiscalización y Control Interno del Fondo

Auditoría Externa

En el mes de abril el despacho KPMG, Cárdenas Dosal, S.C., en su carácter de auditor externo del Fondo, emitió sin observaciones su dictamen a los estados financieros y al informe sobre el ejercicio del presupuesto de gasto de operación del fideicomiso, correspondientes al periodo del 1 de enero al 31 de diciembre de 2020.

Auditoría Interna

La Unidad de Auditoría del Banco de México realizó la auditoría GATIE-38/19, en la que concluyó que el Fondo cumple de manera razonable con los controles de seguridad informática en la infraestructura tecnológica que permite el envío y recepción de la mensajería electrónica utilizada en la concertación y liquidación de sus operaciones realizadas.

Atención al informe del Contralor Interno

La Contraloría Interna del Fondo rindió el “Informe y Dictamen del desempeño de las funciones de la Coordinación Ejecutiva” con opinión favorable sobre el desempeño de la misma y de su personal correspondientes al segundo semestre de 2020 y primer semestre 2021.

d. Estrategia de comunicación

A través de su cuenta de Twitter el Fondo continuó publicando las estadísticas más relevantes de los contratos y asignaciones, así como información relacionada al mercado petrolero mundial. Al finalizar el año se contaba con 15 mil seguidores.

Se logró la certificación nivel AA del estándar Web Content Accessibility Guidelines para la página web del Fondo que garantiza que el diseño, programación y contenidos permitan a personas con alguna discapacidad navegar e interactuar a través de los mismos de una forma sencilla y práctica.

e. Talleres para contratistas

A lo largo del año se realizaron cuatro talleres virtuales destinados a apoyar a los contratistas en el dominio del sistema para registrar la información acerca de las actividades de exploración, producción, así como las inversiones realizadas, donde se contó con la participación de la SHCP, la CNH y la SENER.

Por lo expuesto y fundado, se somete a consideración de ese Órgano Colegiado la siguiente propuesta de

Acuerdo:

El Comité Técnico, con fundamento en el artículo 8, fracción II, inciso a), numeral 5, de la Ley del Fondo Mexicano del Petróleo para la Estabilización y el Desarrollo y la cláusula Décima, fracción I, inciso e), del Contrato Constitutivo del Fondo, aprobó el informe anual 2021, conforme al documento que se agrega al apéndice del acta de la presente sesión.