

ESTADO DE SITUACIÓN FINANCIERA AL 31 DE DICIEMBRE DE:
(CIFRAS EN MILES DE PESOS)

ACTIVO	2020	2019	PASIVO	2020	2019
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
BANCOS MONEDA NACIONAL	1,100	101	ACREEDORES	-	998,505
BANCOS MONEDA EXTRANJERA	28,657	19,506	PROVISIONES PARA GASTOS	2,444	1,273
	29,757	19,607	TOTAL PASIVO	2,444	999,778
RESERVADOS					
DEPOSITOS RESERVADOS AL PAGO FUTURO	-	15,185			
	-	15,185			
INVERSIONES					
INVERSIÓN EN VAL. DE RENTA VARIABLE	1,798,963	1,573,983			
PLUS (MINUS) VALÍA EN VAL. RENTA VARIABLE	440,724	348,854			
INVERSIÓN EN INST. DEUDA NAC. DE TASA REAL PESOS Y UDIS	4,008,743	3,514,576			
PLUS (MINUS) VALÍA EN INST. DEUDA NAC. DE TASA REAL PESOS Y UDIS	1,084,735	655,693			
INVERSIÓN EN INST. DEUDA NAC. DE TASA NOMINAL PESOS	12,451,513	15,372,650			
PLUS (MINUS) VALÍA EN INST. DEUDA NAC. TASA NOM. PESOS	193,909	341,966			
DEPÓSITO TRASPASO BANXICO	-	72,854			
PLUS (MINUS) VALÍA DEPÓSITO TRASPASO BANXICO	-	16			
INVERSIÓN EN INST. DEUDA NAC. DE TASA NOMINAL DIVISAS	188,898	188,898			
PLUS (MINUS) VALÍA INST. DEUDA NAC. TASA NOM. DIVISAS	85,004	76,396			
INVERSIÓN EN FIBRAS	550,810	88,929			
PLUS (MINUS) VALÍA EN INV. EN FIBRAS	(11,621)	(34,657)			
INVERSIÓN EN VALORES EXTRANJEROS DEUDA	3,568,214	1,871,295			
PLUS (MINUS) VALÍA EN VAL. EXT. DEUDA	282,828	74,911			
INVERSIÓN EN TÍTULOS FIDUCIARIOS	8	251,477			
PLUS (MINUS) VALÍA EN TÍTULOS FIDUCIARIOS	32,680	578,511			
	24,675,408	24,976,351			
DEUDORES DIVERSOS					
DIVIDENDOS O DERECHOS POR COBRAR	97	-			
INTERESES DEVENGADOS SOBRE VALORES	69,708	61,513			
REPORTOS	703,509	881,630			
	773,314	943,143			
TOTAL ACTIVO	25,478,479	25,954,287			
			CAPITAL CONTABLE		
			CAPITAL		
			CAPITAL CONTRIBUIDO	(28,699,405)	(27,152,495)
			CAPITAL SOCIAL PAGADO	3,398,753	3,609,668
			PRIMA EN VENTA DE ACCIONES	(32,098,158)	(30,762,163)
			CAPITAL GANADO	52,067,181	50,065,315
			RESULTADO DE EJERCICIOS ANTERIORES	50,065,315	42,829,422
			RESULTADO DEL EJERCICIO	2,001,867	7,235,893
			OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
			PLUS(MINUS) VALÍAS	2,108,259	2,041,689
			TOTALCAPITAL CONTABLE	25,476,036	24,954,509
			TOTAL PASIVO Y CAPITAL	25,478,479	25,954,287
CUENTAS DE ORDEN					
VALORES ENTREGADOS EN CUSTODIA	24,675,408	24,976,351	CAPITAL SOCIAL AUTORIZADO	30,004,000	30,004,000
COLATERALES RECIBIDOS POR REPORTO	702,870	881,827	ACCIONES EMITIDAS	30,004,000,000	30,004,000,000
BANCOS DIVISAS MONEDA EXTRANJERA	1,439	1,034	ACCIONES EN CIRCULACIÓN, POSICIÓN PROPIA	46,734,703	46,734,696
DÓLAR AMERICANO	1,439	1,034	ACCIONES DE SIEFORES, POSICIÓN DE TERCEROS	1,000	1,000
			ACCIONES EN CIRCULACIÓN, PROPIEDAD DE LOS TRABAJADORES	3,352,017,110	3,562,932,342
LA SOCIEDAD VALUADORA DE ESTA SOCIEDAD DE INVERSIÓN DETERMINÓ:					
UNA PLUS (MINUS) VALÍA DE:	2,108,259	2,041,689			
UN VALOR DE LOS ACTIVOS NETOS DE:	25,476,036	24,954,509			
EL PRECIO DE LA ACCIÓN DE:	7.495701	6.913242			

MARIO ORDOÑEZ RODRÍGUEZ
CONTADOR GENERAL DE SIEFORE

DECLARO BAJO PROTESTA DE DECIR VERDAD QUE LOS DATOS CONTENIDOS SON AUTÉNTICOS Y VERACES

JOSE IGNACIO JIMENEZ SANTOS
DIRECTOR GENERAL

DECLARO BAJO PROTESTA DE DECIR VERDAD QUE LOS DATOS CONTENIDOS SON AUTÉNTICOS Y VERACES

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO
INBURSA SIFORE BÁSICA 60-64 , S.A. DE C.V., SOCIEDAD DE INVERSIÓN ESPECIALIZADA DE FONDOS PARA EL RETIRO
SOCIEDAD DE INVERSIÓN BÁSICA

ESTADO DE RESULTADO INTEGRAL

(CIFRAS EN MILES DE PESOS)

POR LOS PERIODOS AL 31 DE DICIEMBRE DE:

	2020	2019
INGRESOS POR LA VENTA DE VALORES	48,627,076	94,811,336
INTERESES, DIVIDENDOS, PREMIOS Y DERECHOS	458,333	1,791,321
RESULTADO CAMBIARIO / OTROS PRODUCTOS	(1,614)	4,126
INGRESOS NETOS	49,083,796	96,606,784
-		
COSTO DE VENTAS DE VALORES	46,841,011	88,748,082
GASTOS GENERALES	3,716	6,455
COMISIONES SOBRE SALDOS	237,201	616,354
EGRESOS NETOS	47,081,929	89,370,891
=		
UTILIDAD DE OPERACIÓN	2,001,867	7,235,893
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	66,570	(5,287,293)
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	2,068,437	1,948,600

MARIO ORDOÑEZ RODRÍGUEZ
 CONTADOR GENERAL DE SIFORE

JOSÉ IGNACIO JIMÉNEZ SANTOS
 DIRECTOR GENERAL

DECLARO BAJO PROTESTA DE DECIR VERDAD QUE LOS DATOS CONTENIDOS SON AUTÉNTICOS Y VERACES

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.

ADMINISTRACIÓN DEL RIESGO FINANCIERO.

La Sociedad de Inversión deberá cumplir con la Trayectoria de Inversión definida para cada trimestre, acorde al perfil de edad de los Trabajadores y la estrategia de inversión de largo plazo definida por el Comité de Inversiones, de igual forma deberá cumplir con los límites autorizados de régimen de inversión de CONSAR.

El Consejo de Administración de Afore Inbursa, ha constituido un Comité de Riesgos Financieros cuyo objeto es el establecimiento y vigilancia del marco prudencial para la administración de los riesgos a los que se encuentra expuesta la Sociedad de Inversión, así tenemos los siguientes:

Riesgo de Mercado.- Es la pérdida potencial en el valor de los Activos Objeto de Inversión debido a movimientos adversos en los factores que determinan su precio. Es administrado a través de metodologías de Valor en Riesgo (VaR). Entendiendo al VaR como la pérdida máxima esperada en un horizonte de tiempo determinado dentro de un nivel de confianza dado. El 31 de diciembre de 2020 el VaR Histórico a un día reportado fue de 0.21%. Como medidas complementarias al VaR, se realizan pruebas bajo escenarios de estrés que consisten en la estimación de las pérdidas que podría sufrir el portafolio ante movimientos de mercado adversos.

Riesgo de Crédito.- Es la pérdida potencial que asume la Sociedad de Inversión como consecuencia del incumplimiento de las obligaciones contractuales de las contrapartes y/o emisores con las que se relaciona. Es administrado a través de la metodología de VaR de Crédito, definido como la suma de la Pérdida Esperada y la Pérdida no Esperada de los Activos Objeto de Inversión y de las Contrapartes, que cuenten con una calificación crediticia otorgada por una Agencia Calificadora. El 31 de diciembre de 2020 el VaR de Crédito ascendió a 0.17% encontrándose dentro del límite prudencial autorizado.

Riesgo de Liquidez.- Es la pérdida esperada por la venta anticipada o forzosa de un Activo Objeto de inversión a descuentos inusuales debido a condiciones extraordinarias de mercado. El modelo para la estimación del Riesgo de Liquidez, consiste en analizar los niveles de operación de los spreads observados en el mercado para cada Activo Objeto de Inversión y a partir de estos, obtener indicadores de descuentos o castigos en caso de estar en la necesidad de liquidar la posición a precios de mercado en una fecha determinada. Adicionalmente la Sociedad de Inversión en caso de contar con posiciones en Derivados deberá cumplir con el nivel diario de Coeficiente de Liquidez. El 31 de diciembre de 2020 se reportó un Riesgo de Liquidez de 0.24% encontrándose dentro de los límites prudencial autorizado.

Riesgo Operativo.- A la posibilidad de ocurrencia de pérdidas por deficiencias o fallas en los procesos operativos, en la tecnología de información, en los recursos humanos o cualquier otro evento externo adverso relacionado con el proceso de inversión, entre los cuales se encuentran comprendidos los siguientes tipos: Legal, Tecnológico y Procesos Operativos. Este riesgo es administrado a través de la estimación de las pérdidas por la materialización de dichos riesgos y el establecimiento de controles preventivos en los procesos.

Para mayor detalle de las características y resultados de la administración integral de riesgos de la Sociedad de Inversión, favor de consultar la página de Internet de Afore Inbursa www.inbursa.com.