

ESTADO DE SITUACIÓN FINANCIERA AL 31 DE DICIEMBRE DE:

(CIFRAS EN MILES DE PESOS)

ACTIVO	2021	2020	PASIVO	2021	2020
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
BANCOS MONEDA NACIONAL	1,100	1,100			
BANCOS MONEDA EXTRANJERA	17,641	18,089	PROVISIONES PARA GASTOS	1,007	1,510
DIVISAS POR RECIBIR	-	97			
	18,741	19,286	TOTAL PASIVO	1,007	1,510
INVERSIONES					
INVERSIÓN EN VAL. DE RENTA VARIABLE	3,526,387	3,051,865			
PLUS (MINUS) VALÍA EN VAL. RENTA VARIABLE	1,271,138	414,850			
INVERSIÓN EN INST. DEUDA NAC. DE TASA REAL PESOS Y UDIS	2,922,204	2,726,766			
PLUS (MINUS) VALÍA EN INST. DEUDA NAC. DE TASA REAL PESOS Y UDIS	734,258	579,218			
INVERSIÓN EN INST. DEUDA NAC. DE TASA NOMINAL PESOS	6,887,738	5,424,571			
PLUS (MINUS) VALÍA EN INST. DEUDA NAC. TASA NOM. PESOS	139,863	145,628			
INVERSIÓN EN INST. DEUDA NAC. DE TASA NOMINAL DIVISAS	183,057	181,027			
PLUS (MINUS) VALÍA INST. DEUDA NAC. TASA NOM. DIVISAS	47,387	79,650			
INVERSIÓN EN FIBRAS	633,768	289,606			
PLUS (MINUS) VALÍA EN INV. EN FIBRAS	9,518	(7,808)			
INVERSIÓN EN VALORES EXTRANJEROS DEUDA	673,259	1,318,820			
PLUS (MINUS) VALÍA EN VAL. EXT. DEUDA	66,348	73,318			
INVERSIÓN EN TÍTULOS FIDUCIARIOS	265,207	265,207			
PLUS (MINUS) VALÍA EN TÍTULOS FIDUCIARIOS	596,880	756,434			
	17,957,013	15,299,151			
DEUDORES DIVERSOS					
LIQUIDADORA	5,907	-			
DIVIDENDOS O DERECHOS POR COBRAR	-	110			
INTERESES DEVENGADOS SOBRE VALORES	44,689	37,121			
REPORTOS	360,010	379,855			
	410,606	417,087			
			CAPITAL CONTABLE		
			CAPITAL		
			CAPITAL CONTRIBUIDO	14,305,345	12,974,784
			CAPITAL SOCIAL PAGADO	15,603,812	14,427,563
			PRIMA EN VENTA DE ACCIONES	(1,298,467)	(1,452,779)
			CAPITAL GANADO	1,214,615	717,940
			RESULTADO DE EJERCICIOS ANTERIORES	717,940	51,338
			RESULTADO DEL EJERCICIO	496,676	666,601
			OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
			PLUS(MINUS) VALÍAS	2,865,393	2,041,290
			TOTAL CAPITAL CONTABLE	18,385,353	15,734,014
			TOTAL PASIVO Y CAPITAL	18,386,360	15,735,524
TOTAL ACTIVO	18,386,360	15,735,524			

CUENTAS DE ORDEN

VALORES ENTREGADOS EN CUSTODIA	17,957,013	15,299,151	CAPITAL SOCIAL AUTORIZADO	500,000,100	500,000,100
COLATERALES RECIBIDOS POR REPORTO	360,037	379,511	ACCIONES EMITIDAS	50,000,010,000	50,000,010,000
BANCOS DIVISAS MONEDA EXTRANJERA	855	909	ACCIONES EN CIRCULACIÓN, POSICIÓN PROPIA	20,275,567	20,275,568
DÓLAR AMERICANO	802	909	ACCIONES DE SIEFORES, POSICIÓN DE TERCEROS	1	1
EUROS	53	-	ACCIONES EN CIRCULACIÓN, PROPIEDAD DE LOS TRABAJADORES	1,540,105,599	1,422,480,745
DIVISAS POR RECIBIR	-	4			
EUROS	-	4			

LA SOCIEDAD VALUADORA DE ESTA SOCIEDAD DE INVERSIÓN DETERMINÓ:

UNA PLUS (MINUS) VALÍA DE:	2,865,393	2,041,290
UN VALOR DE LOS ACTIVOS NETOS DE:	18,385,353	15,734,014
EL PRECIO DE LA ACCIÓN DE:	11.782604	10.905524

MARIO ORDOÑEZ RODRÍGUEZ
 CONTADOR GENERAL DE SIEFORE

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

JOSÉ IGNACIO JIMÉNEZ 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 SIEFORE BÁSICA 80-84, 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:

	2021	2020
INGRESOS POR LA VENTA DE VALORES	15,770,852	20,382,000
INTERESES, DIVIDENDOS, PREMIOS Y DERECHOS	318,153	264,815
RESULTADO CAMBIARIO / OTROS PRODUCTOS	1,732	(673)
	INGRESOS NETOS	20,646,142
-		
COSTO DE VENTAS DE VALORES	15,446,889	19,847,817
GASTOS GENERALES	1,408	2,225
COMISIONES SOBRE SALDOS	145,765	129,498
	EGRESOS NETOS	19,979,540
	=	
	UTILIDAD DE OPERACIÓN	666,601
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	824,104	590,685
	UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	1,257,287

MARIO ORDOÑEZ RODRÍGUEZ

CONTADOR GENERAL DE SIEFORE

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

JOSÉ IGNACIO JIMÉNEZ SANTOS

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.

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 Inversión, 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 2021 el VaR Histórico a un día reportado fue de 0.46%. 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. 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 2021 el VaR de Crédito ascendió a 0.33% 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 2021 se reportó un Riesgo de Liquidez de 0.27% 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.