INBURSA
Siefore Básica 85-89

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

INBURSA SIEFORE BÁSICA 85-89, S.A. DE C.V., SOCIEDAD DE INVERSIÓN ESPECIALIZADA DE FONDOS PARA EL RETIRO

SOCIEDAD DE INVERSIÓN BÁSICA

ESTADO DE SITUACIÓN FINANCIERA AL 31 DE DICIEMBRE DE:

(CIFRAS EN MILES DE PESOS)

ACTIVO	2020	2019
DISPONIBLE		
BANCOS MONEDA NACIONAL	1,100	101
BANCOS MONEDA EXTRANJERA	9,803	9,406
DIVISAS POR RECIBIR	124	-
	11,027	**9,507**
RESERVADOS		
DEPOSITOS RESERVADOS AL PAGO FUTURO	-	31,305
	-	**31,305**
INVERSIONES		
INVERSIÓN EN VAL. DE RENTA VARIABLE	1,996,010	758,180
PLUS (MINUS) VALÍA EN VAL. RENTA VARIABLE	235,611	122,978
INVERSIÓN EN INST. DEUDA NAC. DE TASA REAL PESOS Y UDIS	1,152,673	803,113
PLUS (MINUS) VALÍA EN INST. DEUDA NAC. DE TASA REAL PESOS Y UDIS	258,384	155,771
INVERSIÓN EN INST. DEUDA NAC. DE TASA NOMINAL PESOS	2,842,141	3,213,163
PLUS (MINUS) VALÍA EN INST. DEUDA NAC. TASA NOM. PESOS	79,985	92,160
INVERSIÓN EN INST. DEUDA NAC. DE TASA NOMINAL DIVISAS	96,652	96,652
PLUS (MINUS) VALÍA INST. DEUDA NAC. TASA NOM. DIVISAS	42,318	38,896
INVERSIÓN EN FIBRAS	143,879	24,759
PLUS (MINUS) VALÍA EN INV . EN FIBRAS	**(3,677)**	**(9,333)**
INVERSIÓN EN VALORES EXTRANJEROS DEUDA	596,730	435,278
PLUS (MINUS) VALÍA EN VAL. EXT. DEUDA	30,834	19,045
INVERSIÓN EN TÍTULOS FIDUCIARIOS	131,537	131,537
PLUS (MINUS) VALÍA EN TÍTULOS FIDUCIARIOS	373,987	290,658
	7,977,063	**6,172,858**
DEUDORES DIVERSOS		
DIVIDENDOS O DERECHOS POR COBRAR	64	-
INTERESES DEVENGADOS SOBRE VALORES	17,114	14,075
REPORTOS	284,562	141,549
	301,740	**155,624**
TOTAL ACTIVO	**8,289,830**	**6,369,293**

PASIVO	2020	2019
OBLIGACIONES		
ACREEDORES	-	80,471
PROVISIONES PARA GASTOS	796	322
TOTAL PASIVO	**796**	**80,793**
CAPITAL CONTABLE		
CAPITAL		
CAPITAL CONTRIBUIDO	**(3,544,405)**	**(4,914,080)**
CAPITAL SOCIAL PAGADO	3,862,854	3,191,828
PRIMA EN VENTA DE ACCIONES	**(7,407,259)**	**(8,105,908)**
CAPITAL GANADO	**10,815,997**	**10,492,405**
RESULTADO DE EJERCICIOS ANTERIORES	10,492,405	7,853,665
RESULTADO DEL EJERCICIO	323,592	2,638,740
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS(MINUS) VALÍAS	**1,017,442**	**710,176**
TOTALCAPITAL CONTABLE	**8,289,034**	**6,288,501**
TOTAL PASIVO Y CAPITAL	**8,289,830**	**6,369,293**

CUENTAS DE ORDEN		
VALORES ENTREGADOS EN CUSTODIA	7,977,063	6,172,858
COLATERALES RECIBIDOS POR REPORTO	284,304	141,596
BANCOS DIVISAS MONEDA EXTRANJERA	**492**	**499**
DÓLAR AMERICANO	492	499
DIVISAS POR RECIBIR	**5**	**-**
EUROS	5	-

CAPITAL SOCIAL AUTORIZADO	12,000,100	12,000,100
ACCIONES EMITIDAS	12,000,027,060	12,000,027,060
ACCIONES EN CIRCULACIÓN, POSICIÓN PROPIA	13,479,510	13,479,507
ACCIONES DE SIEFORES, POSICIÓN DE TERCEROS	1	1
ACCIONES EN CIRCULACIÓN, PROPIEDAD DE LOS TRABAJADORES	1,032,616,012	850,895,974

LA SOCIEDAD VALUADORA DE ESTA SOCIEDAD DE INVERSIÓN DETERMINÓ:		
UNA PLUS (MINUS) VALÍA DE:	1,017,442	710,176
UN VALOR DE LOS ACTIVOS NETOS DE:	8,289,034	6,288,501
EL PRECIO DE LA ACCIÓN DE:	7.923783	7.275196

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

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.

INBURSA
Siefore Básica 85-89

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO
INBURSA SIEFORE BÁSICA 85-89, 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	10,505,721	16,631,428
INTERESES, DIVIDENDOS, PREMIOS Y DERECHOS	130,677	539,829
RESULTADO CAMBIARIO / OTROS PRODUCTOS	(128)	1,221
INGRESOS NETOS	**10,636,269**	**17,172,478**
-		
COSTO DE VENTAS DE VALORES	10,245,576	14,391,790
GASTOS GENERALES	1,425	2,789
COMISIONES SOBRE SALDOS	65,677	139,159
EGRESOS NETOS	**10,312,677**	**14,533,737**
=		
UTILIDAD DE OPERACIÓN	**323,592**	**2,638,740**
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	**307,266**	**(2,363,738)**
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	**630,858**	**275,002**

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 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 0.46%. 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 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 0.14% 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 0.46% 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.**