

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	10,868	9,803	PROVISIONES PARA GASTOS	571	796
DIVISAS POR RECIBIR	-	124			
	11,969	11,027	TOTAL PASIVO	571	796
INVERSIONES					
INVERSIÓN EN VAL. DE RENTA VARIABLE	2,267,170	1,996,010			
PLUS (MINUS) VALÍA EN VAL. RENTA VARIABLE	784,132	235,611			
INVERSIÓN EN INST. DEUDA NAC. DE TASA REAL PESOS Y UDIS	1,311,553	1,152,673			
PLUS (MINUS) VALÍA EN INST. DEUDA NAC. DE TASA REAL PESOS Y UDIS	333,305	258,384			
INVERSIÓN EN INST. DEUDA NAC. DE TASA NOMINAL PESOS	4,118,628	2,842,141			
PLUS (MINUS) VALÍA EN INST. DEUDA NAC. TASA NOM. PESOS	80,094	79,985			
INVERSIÓN EN INST. DEUDA NAC. DE TASA NOMINAL DIVISAS	117,021	96,652			
PLUS (MINUS) VALÍA INST. DEUDA NAC. TASA NOM. DIVISAS	27,870	42,318			
INVERSIÓN EN FIBRAS	333,775	143,879			
PLUS (MINUS) VALÍA EN INV. EN FIBRAS	4,548	(3,677)			
INVERSIÓN EN VALORES EXTRANJEROS DEUDA	317,256	596,730			
PLUS (MINUS) VALÍA EN VAL. EXT. DEUDA	26,647	30,834			
INVERSIÓN EN TÍTULOS FIDUCIARIOS	131,537	131,537			
PLUS (MINUS) VALÍA EN TÍTULOS FIDUCIARIOS	295,277	373,987			
	10,148,811	7,977,063			
DEUDORES DIVERSOS					
LIQUIDADORA	3,206	-			
DIVIDENDOS O DERECHOS POR COBRAR	-	64			
INTERESES DEVENGADOS SOBRE VALORES	22,268	17,114			
REPORTOS	234,275	284,562			
	259,749	301,740			
			TOTAL CAPITAL CONTABLE	10,419,958	8,289,034
TOTAL ACTIVO	10,420,528	8,289,830	TOTAL PASIVO Y CAPITAL	10,420,528	8,289,830
CUENTAS DE ORDEN					
VALORES ENTREGADOS EN CUSTODIA	10,148,811	7,977,063	CAPITAL SOCIAL AUTORIZADO	12,000,100	12,000,100
COLATERALES RECIBIDOS POR REPORTO	234,292	284,304	ACCIONES EMITIDAS	12,000,027,060	12,000,027,060
BANCOS DIVISAS MONEDA EXTRANJERA	526	492	ACCIONES EN CIRCULACIÓN, POSICIÓN PROPIA	13,479,509	13,479,510
DÓLAR AMERICANO	492	492	ACCIONES DE SIEFORES, POSICIÓN DE TERCEROS	1	1
EUROS	34	-	ACCIONES EN CIRCULACIÓN, PROPIEDAD DE LOS TRABAJADORES	1,195,724,153	1,032,616,012
DIVISAS POR RECIBIR	-	5			
EUROS	-	5			

LA SOCIEDAD VALUADORA DE ESTA SOCIEDAD DE INVERSIÓN DETERMINÓ:

UNA PLUS (MINUS) VALÍA DE:	1,551,871	1,017,442
UN VALOR DE LOS ACTIVOS NETOS DE:	10,419,958	8,289,034
EL PRECIO DE LA ACCIÓN DE:	8.617207	7.923783

 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 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:

	2021	2020
INGRESOS POR LA VENTA DE VALORES	9,016,496	10,505,721
INTERESES, DIVIDENDOS, PREMIOS Y DERECHOS	171,342	130,677
RESULTADO CAMBIARIO / OTROS PRODUCTOS	511	(128)
INGRESOS NETOS	9,188,348	10,636,269
-		
COSTO DE VENTAS DE VALORES	8,859,569	10,245,576
GASTOS GENERALES	716	1,425
COMISIONES SOBRE SALDOS	79,985	65,677
EGRESOS NETOS	8,940,269	10,312,677
=		
UTILIDAD DE OPERACIÓN	248,079	323,592
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	534,429	307,266
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	782,509	630,858

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 0.51%. 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 forzada 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 0.26% 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.