

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	5,124	9,657	PROVISIONES PARA GASTOS	339	682
	6,224	10,757	TOTAL PASIVO	339	682
INVERSIONES			CAPITAL CONTABLE		
INVERSIÓN EN VAL. DE RENTA VARIABLE	246,081	258,448	CAPITAL		
PLUS (MINUS) VALÍA EN VAL. RENTA VARIABLE	126,976	48,151	CAPITAL CONTRIBUIDO	(2,200,288)	(865,388)
INVERSIÓN EN INST. DEUDA NAC. DE TASA REAL PESOS Y UDIS	3,051,677	2,940,610	CAPITAL SOCIAL PAGADO	1,590,776	2,064,766
PLUS (MINUS) VALÍA EN INST. DEUDA NAC. DE TASA REAL PESOS Y UDIS	643,861	607,178	PRIMA EN VENTA DE ACCIONES	(3,791,064)	(2,930,154)
INVERSIÓN EN INST. DEUDA NAC. DE TASA NOMINAL PESOS	1,003,413	1,610,671	CAPITAL GANADO	7,473,995	7,081,100
PLUS (MINUS) VALÍA EN INST. DEUDA NAC. TASA NOM. PESOS	25,577	32,602	RESULTADO DE EJERCICIOS ANTERIORES	7,081,100	6,550,588
DEPÓSITO TRASPASO BANXICO	2,946	3,816	RESULTADO DEL EJERCICIO	392,895	530,512
PLUS (MINUS) VALÍA DEPÓSITO TRASPASO BANXICO	-	2	OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
INVERSIÓN EN INST. DEUDA NAC. DE TASA NOMINAL DIVISAS	35,937	192,962	PLUS(MINUS) VALÍAS	910,527	896,904
PLUS (MINUS) VALÍA INST. DEUDA NAC. TASA NOM. DIVISAS	8,865	85,596			
INVERSIÓN EN FIBRAS	73,429	71,434			
PLUS (MINUS) VALÍA EN INVERSIÓN EN FIBRAS	(1,956)	(5,222)			
INVERSIÓN EN VALORES EXTRANJEROS DEUDA	653,771	917,535			
PLUS (MINUS) VALÍA EN VAL. EXT. DEUDA	105,743	126,326			
INVERSIÓN EN TÍTULOS FIDUCIARIOS	1	1			
PLUS (MINUS) VALÍA EN TÍTULOS FIDUCIARIOS	1,461	2,272			
	5,977,780	6,892,381			
DEUDORES DIVERSOS					
LIQUIDADORA	521	-			
DIVIDENDOS O DERECHOS POR COBRAR	-	15			
INTERESES DEVENGADOS SOBRE VALORES	43,548	44,092			
REPORTOS	156,501	166,053			
	200,569	210,160			
TOTAL ACTIVO	6,184,574	7,113,298	TOTAL CAPITAL CONTABLE	6,184,235	7,112,616
			TOTAL PASIVO Y CAPITAL	6,184,574	7,113,298
CUENTAS DE ORDEN					
VALORES ENTREGADOS EN CUSTODIA	5,977,780	6,892,381	CAPITAL SOCIAL AUTORIZADO	15,004,000	15,004,000
COLATERALES RECIBIDOS POR REPORTO	156,512	165,902	ACCIONES EMITIDAS	15,004,000,000	15,004,000,000
BANCOS DIVISAS MONEDA EXTRANJERA	250	485	ACCIONES EN CIRCULACIÓN, POSICIÓN PROPIA	15,784,971	15,784,972
DÓLAR AMERICANO	246	485	ACCIONES DE SIEFORES, POSICIÓN DE TERCEROS	1	1
EUROS	4	-	ACCIONES EN CIRCULACIÓN, PROPIEDAD DE LOS TRABAJADORES	742,811,585	912,712,325
LA SOCIEDAD VALUADORA DE ESTA SOCIEDAD DE INVERSIÓN DETERMINÓ:					
UNA PLUS (MINUS) VALÍA DE:	910,527	896,904			
UN VALOR DE LOS ACTIVOS NETOS DE:	6,184,235	7,112,616			
EL PRECIO DE LA ACCIÓN DE:	8.152206	7.660352			

 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 ESTRUCTURA RESPONSABILIDAD DE LOS FUNCIONARIOS QUE SUSCRIBEN.

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO
INBURSA SIEFORE BÁSICA 55-59, 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	4,633,524	6,263,048
INTERESES, DIVIDENDOS, PREMIOS Y DERECHOS	210,165	255,378
RESULTADO CAMBIARIO / OTROS PRODUCTOS	6,037	(380)
INGRESOS NETOS	4,849,726	6,518,046
-		
COSTO DE VENTAS DE VALORES	4,399,919	5,920,239
GASTOS GENERALES	484	1,210
COMISIONES SOBRE SALDOS	56,428	66,086
INTERESES SOBRE INVERSIONES EN VALORES A ENTREGAR	-	-
EGRESOS NETOS	4,456,830	5,987,535
=		
UTILIDAD DE OPERACIÓN	392,895	530,512
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	13,623	199,533
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	406,518	730,045

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 0.26%. 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 0.43% 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 0.23% 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.