

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

ACTIVO	2022	2021	PASIVO	2022	2021
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
BANCOS MONEDA NACIONAL	1,100	1,100			
BANCOS MONEDA EXTRANJERA	9,252	5,124	PROVISIONES PARA GASTOS	253	339
	10,352	6,224	TOTAL PASIVO	253	339
INVERSIONES			CAPITAL CONTABLE		
INVERSIÓN EN VAL. DE RENTA VARIABLE	236,617	246,081			
PLUS (MINUS) VALÍA EN VAL. RENTA VARIABLE	100,734	126,976			
INVERSIÓN EN INST. DEUDA NAC. DE TASA REAL PESOS Y UDIS	3,243,448	3,051,677			
PLUS (MINUS) VALÍA EN INST. DEUDA NAC. DE TASA REAL PESOS Y UDIS	590,908	643,861	CAPITAL		
INVERSIÓN EN INST. DEUDA NAC. DE TASA NOMINAL PESOS	252,129	1,003,413	CAPITAL CONTRIBUIDO	(3,188,486)	(2,200,288)
PLUS (MINUS) VALÍA EN INST. DEUDA NAC. TASA NOM. PESOS	24,015	25,577	CAPITAL SOCIAL PAGADO	1,254,634	1,590,776
DEPÓSITO TRASPASO BANXICO	-	2,946	PRIMA EN VENTA DE ACCIONES	(4,443,121)	(3,791,064)
INVERSIÓN EN INST. DEUDA NAC. DE TASA NOMINAL DIVISAS	32,651	35,937			
PLUS (MINUS) VALÍA INST. DEUDA NAC. TASA NOM. DIVISAS	(2,226)	8,865	CAPITAL GANADO	7,830,677	7,473,995
INVERSIÓN EN FIBRAS	73,429	73,429	RESULTADO DE EJERCICIOS ANTERIORES	7,473,995	7,081,100
PLUS (MINUS) VALÍA EN INVERSIÓN EN FIBRAS	2,170	(1,956)	RESULTADO DEL EJERCICIO	356,681	392,895
INVERSIÓN EN VALORES EXTRANJEROS DEUDA	672,240	653,771			
PLUS (MINUS) VALÍA EN VAL. EXT. DEUDA	47,515	105,743	OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
INVERSIÓN EN TÍTULOS FIDUCIARIOS	1	1	PLUS(MINUS) VALÍAS	764,325	910,527
PLUS (MINUS) VALÍA EN TÍTULOS FIDUCIARIOS	1,210	1,461			
	5,274,839	5,977,780			
DEUDORES DIVERSOS					
LIQUIDADORA	-	521			
DIVIDENDOS O DERECHOS POR COBRAR	11	-			
INTERESES DEVENGADOS SOBRE VALORES	62,190	43,548			
REPORTOS	59,376	156,501			
	121,577	200,569	TOTAL CAPITAL CONTABLE	5,406,515	6,184,235
TOTAL ACTIVO	5,406,768	6,184,574	TOTAL PASIVO Y CAPITAL	5,406,768	6,184,574
CUENTAS DE ORDEN					
VALORES ENTREGADOS EN CUSTODIA	5,274,839	5,977,780	CAPITAL SOCIAL AUTORIZADO	15,004,000	15,004,000
COLATERALES RECIBIDOS POR REPORTO	59,425	156,512	ACCIONES EMITIDAS	15,004,000,000	15,004,000,000
BANCOS DIVISAS MONEDA EXTRANJERA	475	250	ACCIONES EN CIRCULACIÓN, POSICIÓN PROPIA	15,784,973	15,784,971
DÓLAR AMERICANO	468	246	ACCIONES DE SIEFORES, POSICIÓN DE TERCEROS	1	1
EUROS	7	4	ACCIONES EN CIRCULACIÓN, PROPIEDAD DE LOS TRABAJADORES	622,322,289	742,811,585
LA SOCIEDAD VALUADORA DE ESTA SOCIEDAD DE INVERSIÓN DETERMINÓ:					
UNA PLUS (MINUS) VALÍA DE:	764,325	910,527			
UN VALOR DE LOS ACTIVOS NETOS DE:	5,406,515	6,184,235			
EL PRECIO DE LA ACCIÓN DE:	8.472737	8.152206			

 MARIO ORDOÑEZ RODRÍGUEZ
 CONTADOR GENERAL DE SIEFORE

 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

LOS PRESENTES ESTADOS FINANCIEROS HAN SIDO FORMULADOS DE ACUERDO A LAS REGLAS DE AGRUPACION DE CUENTAS ESTABLECIDAS POR LA COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO Y BAJO LA ESTRICTA RESPONSABILIDAD DE LOS FUNCIONARIOS QUE SUSCRIBEN.

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO
INBURSA SIFORE 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:

	2022	2021
INGRESOS POR LA VENTA DE VALORES	1,739,565	4,633,524
INTERESES, DIVIDENDOS, PREMIOS Y DERECHOS	278,998	210,165
RESULTADO CAMBIARIO / OTROS PRODUCTOS	(442)	6,037
INGRESOS NETOS	2,018,120	4,849,726
-		
COSTO DE VENTAS DE VALORES	1,628,888	4,399,919
GASTOS GENERALES	172	484
COMISIONES SOBRE SALDOS	32,378	56,428
EGRESOS NETOS	1,661,439	4,456,830
=		
UTILIDAD DE OPERACIÓN	356,681	392,895
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(146,202)	13,623
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	210,479	406,518

MARIO ORDOÑEZ RODRÍGUEZ
CONTADOR GENERAL DE SIFORE

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 2022 el VaR Histórico a un día reportado fue de 0.31%. 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 cuentan con una calificación crediticia otorgada por una Agencia Calificadora. El 31 de diciembre de 2022 el VaR de Crédito ascendió a 0.19% 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 2022 se reportó un Riesgo de Liquidez de 0.31% 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.