

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	22,973	29,518	PROVISIONES PARA GASTOS	1,711	2,878
DIVISAS POR RECIBIR	-	7			
	24,073	30,625			
			TOTAL PASIVO	1,711	2,878
INVERSIONES					
INVERSIÓN EN VAL. DE RENTA VARIABLE	2,852,284	2,726,399			
PLUS (MINUS) VALÍA EN VAL. RENTA VARIABLE	1,313,319	537,677			
INVERSIÓN EN INST. DEUDA NAC. DE TASA REAL PESOS Y UDIS	6,132,125	4,846,931			
PLUS (MINUS) VALÍA EN INST. DEUDA NAC. DE TASA REAL PESOS Y UDIS	1,574,092	1,207,271			
INVERSIÓN EN INST. DEUDA NAC. DE TASA NOMINAL PESOS	13,395,053	14,477,326			
PLUS (MINUS) VALÍA EN INST. DEUDA NAC. TASA NOM. PESOS	182,636	200,078			
DEPÓSITO TRASPASO BANXICO	122,672	121,685			
PLUS (MINUS) VALÍA DEPÓSITO TRASPASO BANXICO	15	77			
INVERSIÓN EN INST. DEUDA NAC. DE TASA NOMINAL DIVISAS	132,578	207,370			
PLUS (MINUS) VALÍA INST. DEUDA NAC. TASA NOM. DIVISAS	14,772	93,320			
INVERSIÓN EN FIBRAS	1,084,731	547,268			
PLUS (MINUS) VALÍA EN INV. EN FIBRAS	16,427	(16,724)			
INVERSIÓN EN VALORES EXTRANJEROS DEUDA	2,676,602	3,560,372			
PLUS (MINUS) VALÍA EN VAL. EXT. DEUDA	255,271	252,852			
INVERSIÓN EN TÍTULOS FIDUCIARIOS	261,849	261,849			
PLUS (MINUS) VALÍA EN TÍTULOS FIDUCIARIOS	600,194	763,766			
	30,614,618	29,787,517			
DEUDORES DIVERSOS					
LIQUIDADORA	8,070	-			
DIVIDENDOS O DERECHOS POR COBRAR	-	128			
INTERESES DEVENGADOS SOBRE VALORES	85,471	79,171			
REPORTOS	643,306	241,978			
	736,847	321,277			
			CAPITAL CONTABLE		
			CAPITAL		
			CAPITAL CONTRIBUIDO	24,642,305	25,441,057
			CAPITAL SOCIAL PAGADO	27,001,622	27,716,000
			PRIMA EN VENTA DE ACCIONES	(2,359,317)	(2,274,942)
			CAPITAL GANADO	2,774,797	1,657,168
			RESULTADO DE EJERCICIOS ANTERIORES	1,657,168	83,916
			RESULTADO DEL EJERCICIO	1,117,630	1,573,252
			OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
			PLUS(MINUS) VALÍAS	3,956,725	3,038,318
			TOTAL CAPITAL CONTABLE	31,373,827	30,136,542
			TOTAL PASIVO Y CAPITAL	31,375,539	30,139,420
CUENTAS DE ORDEN					
VALORES ENTREGADOS EN CUSTODIA	30,614,618	29,787,517	CAPITAL SOCIAL AUTORIZADO	800,000,100	800,000,100
COLATERALES RECIBIDOS POR REPORTE	643,123	241,759	ACCIONES EMITIDAS	115,793,710,058	115,793,710,058
BANCOS DIVISAS MONEDA EXTRANJERA	1,116	1,483	ACCIONES EN CIRCULACIÓN, POSICIÓN PROPIA	47,255,351	47,255,351
DÓLAR AMERICANO	1,070	1,483	ACCIONES DE SIEFORES, POSICIÓN DE TERCEROS	1	1
EUROS	46	-	ACCIONES EN CIRCULACIÓN, PROPIEDAD DE LOS TRABAJADORES	3,861,016,710	3,964,417,174
LA SOCIEDAD VALUADORA DE ESTA SOCIEDAD DE INVERSIÓN DETERMINÓ:					
UNA PLUS (MINUS) VALÍA DE:	3,956,725	3,038,318			
UN VALOR DE LOS ACTIVOS NETOS DE:	31,373,827	30,136,542			
EL PRECIO DE LA ACCIÓN DE:	8.027544	7.512214			

 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 SIFORE BÁSICA 65-69, 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	38,550,715	54,426,134
INTERESES, DIVIDENDOS, PREMIOS Y DERECHOS	509,229	498,477
RESULTADO CAMBIARIO / OTROS PRODUCTOS	5,369	(1,801)
INGRESOS NETOS	39,065,314	54,922,811
-		
COSTO DE VENTAS DE VALORES	37,683,049	53,079,481
GASTOS GENERALES	2,015	3,874
COMISIONES SOBRE SALDOS	262,620	266,204
EGRESOS NETOS	37,947,684	53,349,559
=		
UTILIDAD DE OPERACIÓN	1,117,630	1,573,252
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	918,407	851,444
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	2,036,037	2,424,696

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 2021 el VaR Histórico a un día reportado fue de 0.27%. 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 2021 el VaR de Crédito ascendió a 0.34% 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 0.22% 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.